

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

Ata CA. nº07/2020. Aos dezesseis dias de julho de 2.020, às 09:30hs, na sede do BERTPREV, reuniram-se os membros do Conselho Administrativo do Instituto, Adriana dos Santos Rodrigues, Ronaldo Mendes, Fabiano Teles de Oliveira, Marcelo dos Santos Pereira, Jaime Furtado de Mello Júnior, e por acesso remoto via internet, conforme convocação, os Srs. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do BERTPREV, e André Girenz Rodrigues, com a presença do Sr. Alexandre Hope Herrera, Coordenador Administrativo-Financeiro. Na sequência o Sr. André, lembrou aos presentes que foram enviados por e-mail os arquivos com as atas do comitê de investimentos nº23, 24, 25 e 26/2020 (atas de junho/2020), relatório de investimentos junho/2020. Informou ainda que as atas se encontram disponíveis no site do BERTPREV. Registra-se a renúncia formal do Sr Vanderlei Poletto e oficiada a titularidade do Conselheiro Jaime, em substituição ao Sr Luiz Antônio Batista Simões. Passou-se a apreciação das atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho por unanimidade em referendar as atas nºs 23, 24 25 e 26/2020 (atas de junho/2020). O Sr. Alexandre apresentou o resultado dos investimentos no mês de junho/2020. Em resumo o resultado mensal foi de R\$ 569.327.292,31, apresentando uma variação positiva em virtude da marcação a mercado de R\$18.217.804,43, conforme quadros abaixo:

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno (%)	Meta (%)
Janeiro	575.620.806,32	582.196.736,89	5.672.930,57	0,98%	0,71%
Fevereiro	582.196.736,89	567.851.216,58	-5.973.869,85	-1,02%	0,66%
Março	567.851.216,58	512.503.688,18	-67.179.528,40	-11,57%	0,57%
Abril	512.503.688,18	529.408.059,03	16.904.370,85	3,30%	0,14%
Maiο	529.408.059,03	540.406.026,32	14.792.878,07	2,82%	0,07%
Junho	540.406.026,32	569.327.292,31	18.217.804,43	3,36%	0,74%
		TOTAL	-35.783.218,76	-2,96%	2,93%

Registra-se o Memorando nº 94/2020 – ADM, acerca da entrega da declaração de bem e dos documentos solicitados pelo Ministério da Previdência até 29/06/2020. Foi apresentado protocolo de retificação da Lei municipal 1.391/2019, na Câmara Municipal, diante disso o conselho aguarda a aprovação. O Sr. Alexandre informa que as contribuições recolhidas referentes à gratificação dos especialistas em educação continuam sendo devolvidas até a regularização da Lei. A Sra. Darci Pereira de Macedo, Presidente do conselho fiscal, explicou acerca do pedido de alteração dos dias das reuniões do conselho administrativo para as quartas quintas-feiras do mês, deliberando o conselho administrativo em estudar o pedido para posterior decisão. Foi solicitado à procuradoria do instituto que faça análise das portarias expedidas pela Secretaria da Previdência, no que tange o funcionamento e atribuições dos conselhos, verificando eventual conflito frente ao regimento atual. Registra-se também o Relatório Anual do Controle Interno, Exercício 2019, enviada aos conselheiros via e-mail, aprovado por unanimidade. Esta ata e seus anexos estarão disponibilizados para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Nada mais havendo a tratar, encerrou-se a reunião às 11:30, sendo lavrada a ata por mim, André Girenz Rodrigues que após lida e discutida a mesma foi colocada em votação e aprovada por unanimidade, que segue assinada pelos presentes.

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Ronaldo Mendes _____

Jaime Furtado de Mello Júnior _____

André Girenz Rodrigues _____

Marcelo dos Santos Pereira _____

Adriana dos Santos Rodrigues _____

Fabiano Teles de Oliveira _____

Alexandre Hope Herrera _____

BERTIOGA 10/06/2020

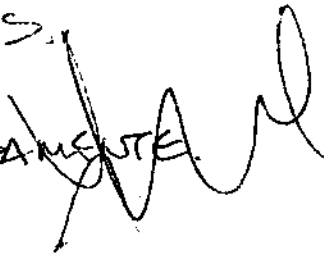
AO BERTPREV - CONSELHO ADMINISTRATIVO
SR. PRESIDENTE WALDEMAR CESAR

VENHO ATRAVÉS DESTA SOLICITAR A
RENÚNCIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO, UMA VEZ
QUE ESTOU IMPEDIDO DE PARTICIPAR DE REUNIÕES

~~POR MOTIVOS PARTICULARES~~

SEM MAIS.

ATENCIOSAMENTE.



574908138 - 91
Vandersoni Polatto

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.



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

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 23/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
 Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

3 de junho de 2020 13:09

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório

semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

 **wilson.paschoal@uol.com.br** <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

3 de junho de 2020 13:32

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 23/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>

3 de junho de 2020 14:15

Responder a: "clayfs@yahoo.com.br" <clayfs@yahoo.com.br>

Para: "maristela.comite@gmail.com" <maristela.comite@gmail.com>

De acordo,

Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

<div>Em qua, 3 3e jun 3e 2020 às 13:10, MARISTELA TEODORO</div><div><maristela.comite@gmail.com> escreveu:</div>

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375

Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408
---------------------------	---------------	------	--------	---------	---------

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 em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 23/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

3 de junho de 2020 13:09

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório

semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

wilson.paschoal@uol.com.br <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

3 de junho de 2020 13:32

Ciente e de acordo.
[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 14:36

Boa Tarde!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado: quarta-feira, 3 de junho de 2020 11:09
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>
Assunto: ATA 23/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



Relatório Semanal de Investimentos

03 de junho de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 22/05/2020	Posição 29/05/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/19 Evolução PL	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	530.695.098,83	540.839.467,86	1,91%	100,0%	100,0%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%						
	Títulos Públicos Federais	158.735.111,22	160.430.629,99	1,07%	29,66%	100,0%	100,0%		30,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.735.111,22	160.430.629,99	1,07%	29,66%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	107.937.697,97	108.896.346,96	0,89%	20,13%				22,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.593.197,00	19.852.651,00	1,32%	3,671%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2020 II TP	16.087.626,00	16.322.410,00	1,46%	3,018%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	16.060.526,37	16.105.334,29	0,28%	2,978%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.248.206,34	30.446.645,54	0,66%	5,630%						
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.669.606,73	16.837.038,97	1,00%	3,113%						
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.278.535,53	9.332.267,16	0,58%	1,726%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.407.529,63	125.721.531,11	0,25%	23,25%				17,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.078.641,92	25.096.228,29	0,07%	4,640%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.328.887,71	100.625.302,82	0,30%	18,605%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.881.698,80	3.911.985,22	0,78%	0,72%				0,70%	15,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.881.698,80	3.911.985,22	0,78%	0,723%						
	Fundos de Investimentos em Ações	115.659.851,85	122.805.765,22	6,18%	22,71%				20,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.686.062,95	15.465.340,46	5,31%	2,860%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	16.042.219,97	17.104.917,82	6,62%	3,163%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	37.681.835,99	40.090.166,73	6,39%	7,413%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.152.443,32	6.450.559,51	4,85%	1,193%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.643.891,97	7.047.376,58	6,07%	1,303%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	31.562.554,15	33.555.363,43	6,31%	6,204%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.890.843,50	3.092.040,69	6,96%	0,572%						
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.073.209,36	0,00%	3,53%				3,00%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.809.379,41	0,00%	1,074%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	13.263.829,95	13.263.829,95	0,00%	2,452%						

(*)

Alexandre Hope Herrera

Coord. Adm. Financeira

Reg.: 019 Bertprev

Comitê de Investimentos

Ata nº 24/2020—aos dez dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 05/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,25	-6,48
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	2,13
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,39	1,41
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7774	4,5647
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7096	4,5055
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,4497	4,2785
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	3,6734	3,5987
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -09/06/2020	2020	Elevação	2,3345	2,3692
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	0,8014	0,742
Ibovespa	09/06/2020	2020	Elevação	91.046	96.746
Risco Brasil (JP Morgan)	08/06/2020	2020	Redução	375	332
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices, exceto no 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 96.746 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 05/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.663M e o relatório mensal de Maio/2020 de R\$ 540.406M. Requeremos ao Sr. Presidente do Bertprev que solicite a LDB Consultoria a análise da instituição e dos fundos da Caixa Econômica Federal. Participaram remotamente da reunião os Srs. Fernando Friaça, Renato, José Lucena, Carol e Sérgio Angelim representantes da Mauá Capital. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.



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

Clayton Faria Schmidt

2

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 24/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>

10 de junho de 2020 14:09

Responder a: "clayfs@yahoo.com.br" <clayfs@yahoo.com.br>

Para: "maristela.comite@gmail.com" <maristela.comite@gmail.com>

Boa tarde Maristela,

De acordo.

Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

<div>Em qua, 10 10e jun 10e 2020 às 13:08, MARISTELA TEODORO</div><div><maristela.comite@gmail.com> escreveu:</div>

Boa tarde!

Segue Ata 24/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 24/2020—aos dez dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 05/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,25	-6,48
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	2,13
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,39	1,41
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –09/06/2020	2020	Redução	4,7774	4,5647
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –09/06/2020	2020	Redução	4,7096	4,5055
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –09/06/2020	2020	Redução	4,4497	4,2785
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –09/06/2020	2020	Redução	3,6734	3,5987
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –09/06/2020	2020	Elevação	2,3345	2,3692
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –09/06/2020	2020	Redução	0,8014	0,742
Ibovespa	09/06/2020	2020	Elevação	91.046	96.746

Risco Brasil (JP Morgan)	08/06/2020	2020	Redução	375	332
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices, exceto no 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 96.746 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 05/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.663M e o relatório mensal de Maio/2020 de R\$ 540.406M. Requeremos ao Sr. Presidente do Bertprev que solicite a LDB Consultoria a análise da instituição e dos fundos da Caixa Econômica Federal. Participaram remotamente da reunião os Srs. Fernando Friaça, Renato, José Lucena, Carol e Sérgio Angelim representantes da Mauá Capital. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 24/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

10 de junho de 2020 13:07

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Boa tarde!

Segue Ata 24/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 24/2020—aos dez dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 05/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,25	-6,48
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	2,13
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,39	1,41
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7774	4,5647
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7096	4,5055
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,4497	4,2785
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	3,6734	3,5987
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -09/06/2020	2020	Elevação	2,3345	2,3692
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	0,8014	0,742
Ibovespa	09/06/2020	2020	Elevação	91.046	96.746
Risco Brasil (JP Morgan)	08/06/2020	2020	Redução	375	332
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices, exceto no 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para

96.746 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 05/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.663M e o relatório mensal de Maio/2020 de R\$ 540.406M. Requeremos ao Sr. Presidente do Bertprev que solicite a LDB Consultoria a análise da instituição e dos fundos da Caixa Econômica Federal. Participaram remotamente da reunião os Srs. Fernando Friaça, Renato, José Lucena, Carol e Sérgio Angelim representantes da Mauá Capital. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

10 de junho de 2020 17:06

Ciente e de acordo.

✈ José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quarta-feira, 10 de junho de 2020 11:07

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 24/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 14:35

Boa Tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quarta-feira, 10 de junho de 2020 11:07

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 24/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 24/2020

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>

10 de junho de 2020 15:02

Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Ok! Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>

Enviada: 2020/06/10 13:08:01

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: ATA 24/2020

Boa tarde!

Segue Ata 24/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 24/2020—aos dez dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 relat&oacut e;rio *Focus* de 05/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,25	-6,48
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	2,13
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,39	1,41
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7774	4,5647
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,7096	4,5055
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	4,4497	4,2785
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	3,6734	3,5987

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -09/06/2020	2020	Elevação	2,3345	2,3692
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/06/2020	2020	Redução	0,8014	0,742
Ibovespa	09/06/2020	2020	Elevação	91.046	96.746
Risco Brasil (JP Morgan)	08/06/2020	2020	Redução	375	332
Posição dos Investimentos	Mar/20-Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 em todos os vértices, exceto no 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 96.746 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 05/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.663M e o relatório mensal de Maio/2020 de R\$ 540.406M. Requeremos ao Sr. Presidente do Bertprev que solicite a LDB Consultoria a análise da instituição e dos fundos da Caixa Econômica Federal. Participaram remotamente da reunião os Srs. Fernando Fria&cc edil;a, Renato, José Lucena, Carol e Sérgio Angelim representantes da Mauá Capital. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____



*

Relatório Semanal de Investimentos

10 de junho de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 29/05/2020	Posição 05/06/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pró-geração Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	540.839.467,86	551.663.589,59	2,00%	100,00%	0,000%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA										
CP 0184	Títulos Públicos Federal	160.430.629,99	162.872.440,03	1,52%	29,52%	100,00%			30,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	160.430.629,99	162.872.440,03	1,52%	29,52%	100,00%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	108.896.346,96	109.089.067,57	0,18%	19,77%				22,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.837.038,97	16.480.486,28	-2,12%	2,987%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.105.334,29	16.151.194,80	0,28%	2,928%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.446.645,54	30.614.128,70	0,55%	5,549%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.322.410,00	16.477.190,80	0,95%	2,987%	100,00%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.852.651,00	19.995.586,00	0,72%	3,625%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.332.267,16	9.370.480,99	0,41%	1,699%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.721.531,11	125.969.933,84	0,20%	22,83%				17,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.096.228,29	25.110.432,39	0,06%	4,552%						
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	100.625.302,82	100.859.501,45	0,23%	18,283%	40,00%	50,00%				
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.911.985,22	3.932.953,53	0,54%	0,71%				0,70%	15,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.911.985,22	3.932.953,53	0,54%	0,713%	5,00%	15,00%				
	Fundos de Investimentos em Ações	122.805.765,22	130.739.683,44	6,46%	23,70%				20,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	17.104.917,82	18.201.567,40	6,41%	3,299%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	15.465.340,46	16.266.913,60	5,18%	2,949%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.450.559,51	6.858.471,24	6,32%	1,243%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	40.090.166,73	42.653.614,68	6,39%	7,732%	20,00%	30,00%				
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	33.555.363,43	35.954.791,69	7,15%	6,518%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.047.376,58	7.541.792,50	7,02%	1,367%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.092.040,69	3.262.532,33	5,51%	0,591%						
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.059.511,18	-0,07%	3,45%				3,00%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.803.474,75	-0,10%	1,052%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.263.829,95	13.256.036,43	-0,06%	2,403%	5,00%	5,00%				

(*)

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



Relatório de Investimentos

Maio

2020

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMH Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.862.782,89 -R\$ 35.456.756,58	27,22% -6,16%
Fundo		Patrimônio	% PL	CMH Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.862.782,89 -R\$ 35.456.756,58	27,22% -6,16%
TOTAL PATRIMÔNIO		540.406.026,31	100,0%	Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		2,08%
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA		0,00%					
CP 0184	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	160.430.629,98	29,69%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	100,00%
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	160.430.629,98	29,69%					
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	108.476.603,55	20,07%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.417.295,56	3,038%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.105.334,29	2,980%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.446.645,54	5,634%	100,00%	100,00%			
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.322.410,00	3,020%					
	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.852.651,00	3,674%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	9.332.267,16	1,727%					
Fundos Renda Fixa em geral		125.721.531,12	23,26%			0,00%	17,30%	50,00%
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.096.228,29	4,644%	40,00%	50,00%			
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.625.302,83	18,620%					
FI Renda Fixa "Crédito Privado"		3.911.985,22	0,72%			0,00%	0,70%	15,00%
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.911.985,22	0,724%	5,00%	15,00%			
Fundos de Investimentos de Ações em geral		122.805.765,26	22,73%			0,00%	20,00%	30,00%
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	17.104.917,84	3,165%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	15.465.340,43	2,862%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.450.559,51	1,194%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	40.090.166,77	7,419%	20,00%	30,00%			
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	33.555.363,44	6,209%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.047.376,58	1,304%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.092.040,69	0,572%					
FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturado)		19.059.511,18	3,53%			0,00%	3,00%	5,00%
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.803.474,75	1,074%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MUL	13.256.036,43	2,453%	5,00%	5,00%			

Alexandre Flope Herrera
Coord. Adm. - Bertprev
Reg.: 019



Relatório de Investimentos

Abril/20 - Maio/20

CNPJ	Fundo	Competência abril/20	Competência maio/20	Variação Mensal	% PL	Limite % PL 3922/10	Limite % PL 3922/10	Saldo Dez/18 Evolução PL	R\$ 452.636.394,03 R\$ 87.769.632,28	17,42% 19,39%
TOTAL PATRIMÔNIO		529.407.059,06	540.406.026,31	2,08%	100,0%	100,0%		Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	161.404.755,33	160.430.629,98	-0,60%	29,69%	100,00%		10,00%	31,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	161.404.755,33	160.430.629,98	-0,60%	29,69%	100,00%				
	Fundos 100% Títulos Públicos	106.906.174,37	108.476.603,55	1,47%	20,07%			10,00%	16,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.426.152,54	16.417.295,56	-0,05%	3,038%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	15.906.815,12	16.105.334,29	1,25%	2,980%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.123.676,34	30.446.645,54	1,07%	5,634%	100,00%				
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.039.602,00	16.322.410,00	1,76%	3,020%					
	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.245.733,00	19.852.651,00	3,15%	3,674%					
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	9.164.195,37	9.332.267,16	1,83%	1,727%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.125.241,30	125.721.531,12	0,48%	23,26%			0,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.040.866,17	25.096.228,29	0,22%	4,644%	40,00%				
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.084.375,13	100.625.302,83	0,54%	18,620%	50,00%				
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.828.786,45	3.911.985,22	2,17%	0,72%			0,00%	1,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.828.786,45	3.911.985,22	2,17%	0,724%	15,00%				
07.279.657/0001-89	Fundos de Investimentos em Ações	113.068.892,25	122.805.765,26	8,61%	22,72%			0,00%	20,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
	QUEST AÇÕES FIC FIA	15.645.137,93	17.104.917,84	9,33%	3,165%					
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.619.050,84	15.465.340,43	5,79%	2,862%					
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.979.296,53	6.450.559,51	7,88%	1,194%					
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.354.100,97	40.090.166,77	10,28%	7,419%	20,00%				
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	31.087.973,07	33.555.363,44	7,94%	6,209%	30,00%				
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.507.129,26	7.047.376,58	8,30%	1,304%					
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.876.203,65	3.092.040,69	7,50%	0,572%					
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.059.511,18	-0,07%	3,53%			0,00%	3,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.803.474,75	-0,10%	1,074%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	13.263.829,95	13.256.036,43	-0,06%	2,453%					

(*)

Alexandre Hope Herrera
Coord. Admin. Financeira
Reg.: 019/2019



Relatório de Investimentos

Abril/20 - Maio/20

CNPJ	Fundo	Competência abril/20	Competência maio/20	Variação Mensal	% PL	Limite % PL 3922/10	Limite % PL 4604/17	Limite inferior (%)	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	529.407.059,06	540.406.026,31	2,08%	100,0%	0,000%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA										
	Títulos Públicos Federais	161.404.755,33	160.430.629,98	-0,60%	29,69%	100,00%		10,00%	31,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	161.404.755,33	160.430.629,98	-0,60%	29,69%	100,00%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	106.906.174,37	108.476.603,55	1,47%	20,07%			10,00%	16,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.426.152,54	16.417.295,56	-0,05%	3,038%						
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	15.906.815,12	16.105.334,29	1,25%	2,980%						
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.123.676,34	30.446.645,54	1,07%	5,634%	100,00%					
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.039.602,00	16.322.410,00	1,76%	3,020%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.245.733,00	19.852.651,00	3,15%	3,674%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	9.164.195,37	9.332.267,16	1,83%	1,727%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.125.241,30	125.721.531,12	0,48%	23,26%			0,00%	22,00%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.040.866,17	25.096.228,29	0,22%	4,644%	40,00%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.084.375,13	100.625.302,83	0,54%	18,620%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.828.786,45	3.911.985,22	2,17%	0,72%			0,00%	1,00%	15,00%	Artigo 8, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.828.786,45	3.911.985,22	2,17%	0,724%	5,00%					
	Fundos de Investimentos em Ações	113.068.892,25	122.805.765,26	8,61%	22,72%			0,00%	20,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	15.645.137,93	17.104.917,84	9,33%	3,165%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.619.050,84	15.465.340,43	5,79%	2,862%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.979.296,53	6.450.559,51	7,88%	1,194%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.354.100,97	40.090.166,77	10,28%	7,419%	20,00%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	31.087.973,07	33.555.363,44	7,94%	6,209%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.507.129,26	7.047.376,58	8,30%	1,304%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.876.203,65	3.092.040,69	7,50%	0,572%						
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.059.511,18	-0,07%	3,53%			0,00%	3,00%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.803.474,75	-0,10%	1,074%	5,00%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	13.263.829,95	13.256.036,43	-0,06%	2,453%						

(*)

Alexandre Hope Herrera
Coord. Admin. Financeira
Reg.: 019/2019

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2020—aos dezoito dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 12/06/2020, merecedores de destaque:

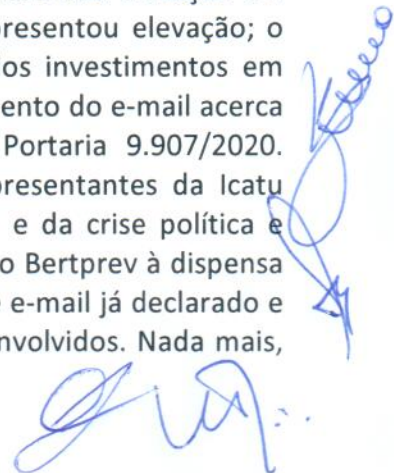
COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,48	-6,51
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,40	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,13	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,41	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5647	4,6368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5055	4,5687
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,2785	4,3076
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	3,5987	3,5303
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	2,3692	2,2417
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	0,742	0,7982
Ibovespa	17/06/2020	2020	Redução	96.746	95.547
Risco Brasil (JP Morgan)	16/06/2020	2020	Elevação	332	367
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu ontem pela redução da taxa básica de juros SELIC para 2,25% a.a., a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, exceto no 2520 d.u. e 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 95.547 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 18/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.475M. Acusamos o recebimento do e-mail acerca da entrega de documentos para o Bertprev em atendimento à Portaria 9.907/2020. Participaram remotamente da reunião as Sras. Priscila e Maira representantes da Icatu Vanguarda. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:37 horas, e lavrada em ata.





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

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 25/2020

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 13:05

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/06/18 12:43:40
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 25/2020

Boa tarde!

Segue Ata 25/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2020—aos dezoito dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 relat&o acute;ri o *Focus* de 12/06/2020, mercedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,48	-6,51
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,40	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,13	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,41	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5647	4,6368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5055	4,5687
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,2785	4,3076
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	3,5987	3,5303
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	2,3692	2,2417

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -17/06/2020	2020	Elevação	0,742	0,7982
Ibovespa	17/06/2020	2020	Redução	96.746	95.547
Risco Brasil (JP Morgan)	16/06/2020	2020	Elevação	332	367
Posição dos Investimentos	Mar/20-Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu ontem pela redução da taxa básica de juros SELIC para 2,25% a.a., a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, exceto no 2520 d.u. e 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 95.547 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 18/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.475M. Acusamos o recebimento do e-mail acerca da entrega de documentos para o Bertprev em atendimento à Portaria 9.907/2020. Participaram remotamente da reunião as Sras. P riscila e Maira representantes da Icatu Vanguarda. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:37 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 25/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
 Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

18 de junho de 2020 12:43

Boa tarde!

Segue Ata 25/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2020—aos dezoito dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 12/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,48	-6,51
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,40	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,13	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,41	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5647	4,6368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5055	4,5687
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,2785	4,3076
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	3,5987	3,5303
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	2,3692	2,2417
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	0,742	0,7982
Ibovespa	17/06/2020	2020	Redução	96.746	95.547
Risco Brasil (JP Morgan)	16/06/2020	2020	Elevação	332	367
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu ontem pela redução da taxa básica de juros SELIC para 2,25% a.a., a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, exceto no 2520 d.u. e 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 95.547

pontos; o relatório semanal dos investimentos em 18/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.475M. Acusamos o recebimento do e-mail acerca da entrega de documentos para o Bertprev em atendimento à Portaria 9.907/2020. Participaram remotamente da reunião as Sras. Priscila e Maira representantes da Icatu Vanguarda. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:37 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 12:58

Obrigado Maristela,

De acordo,
Clayton Faria Schmidt

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 25/2020

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
 Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 13:05

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
 Enviada: 2020/06/18 12:43:40
 Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
 Assunto: ATA 25/2020

Boa tarde!

Segue Ata 25/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2020—aos dezoito dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 relat&o acute;ri o *Focus* de 12/06/2020, mercedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,48	-6,51
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,40	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,13	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,41	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5647	4,6368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5055	4,5687
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,2785	4,3076
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	3,5987	3,5303
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	2,3692	2,2417

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -17/06/2020	2020	Elevação	0,742	0,7982
Ibovespa	17/06/2020	2020	Redução	96.746	95.547
Risco Brasil (JP Morgan)	16/06/2020	2020	Elevação	332	367
Posição dos Investimentos	Mar/20-Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu ontem pela redução da taxa básica de juros SELIC para 2,25% a.a., a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, exceto no 2520 d.u. e 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 95.547 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 18/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.475M. Acusamos o recebimento do e-mail acerca da entrega de documentos para o Bertprev em atendimento à Portaria 9.907/2020. Participaram remotamente da reunião as Sras. P riscila e Maira representantes da Icatu Vanguarda. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:37 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 25/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 12:43

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Boa tarde!

Segue Ata 25/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 25/2020—aos dezoito dias do mês de junho 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 12/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-6,48	-6,51
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,40	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,13	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	1,41	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5647	4,6368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,5055	4,5687
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	4,2785	4,3076
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	3,5987	3,5303
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –17/06/2020	2020	Redução	2,3692	2,2417
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –17/06/2020	2020	Elevação	0,742	0,7982
Ibovespa	17/06/2020	2020	Redução	96.746	95.547
Risco Brasil (JP Morgan)	16/06/2020	2020	Elevação	332	367
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu ontem pela redução da taxa básica de juros SELIC para 2,25% a.a., a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, exceto no 2520 d.u. e 1260 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 95.547

pontos; o relatório semanal dos investimentos em 18/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 551.475M. Acusamos o recebimento do e-mail acerca da entrega de documentos para o Bertprev em atendimento à Portaria 9.907/2020. Participaram remotamente da reunião as Sras. Priscila e Maira representantes da Icatu Vanguarda. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:37 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 12:58

Obrigado Maristela,

De acordo,
Clayton Faria Schmidt

[Texto das mensagens anteriores oculto]

 **José Daniel Rodrigues** <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

18 de junho de 2020 14:37

Boa Tarde!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado: quinta-feira, 18 de junho de 2020 10:43

18/06/2020

Gmail - ATA 25/2020

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 25/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



*

Relatório Semanal de Investimentos

18 de junho de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 05/06/2020	Posição 15/06/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 -R\$ 25.060.299,38	27,37% -4,35%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	551.663.589,59	551.475.321,46	-0,03%	100,0%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%					
	Títulos Públicos Federais	162.872.440,03	163.608.711,26	0,45%	29,67%	100,00%		10,00%	30,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	162.872.440,03	163.608.711,26	0,45%	29,67%	100,00%		10,00%	30,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	109.089.067,57	109.123.909,95	0,03%	19,79%	100,00%		10,00%	22,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.480.486,28	16.439.515,76	-0,25%	2,981%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.151.194,80	16.178.618,20	0,17%	2,934%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.614.128,70	30.643.829,98	0,10%	5,557%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.477.190,80	16.606.680,80	0,79%	3,011%	100,00%				
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.995.586,00	19.888.245,00	-0,54%	3,606%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.370.480,99	9.367.020,21	-0,04%	1,699%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.969.933,84	126.050.979,23	0,06%	22,86%	40,00%		0,00%	17,30%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.110.432,39	25.123.825,16	0,05%	4,556%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	100.859.501,45	100.927.154,07	0,07%	18,301%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.932.953,53	3.929.958,45	-0,08%	0,71%	5,00%		0,00%	0,70%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.932.953,53	3.929.958,45	-0,08%	0,713%					
	Fundos de Investimentos em Ações	130.739.683,44	129.702.251,39	-0,79%	23,52%			0,00%	20,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	18.201.567,40	18.156.721,59	-0,25%	3,292%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	16.266.913,60	16.125.165,30	-0,87%	2,924%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.858.471,24	6.676.070,14	-2,66%	1,211%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	42.653.614,68	42.796.951,11	0,34%	7,760%	20,00%				
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	35.954.791,69	35.318.985,99	-1,77%	6,404%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.541.792,50	7.439.801,95	-1,35%	1,349%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.262.532,33	3.188.555,31	-2,27%	0,578%					
	Fundo de Investimento em Participações	19.059.511,18	19.059.511,18	0,00%	3,46%	5,00%		0,00%	3,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.803.474,75	5.803.474,75	0,00%	1,052%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.256.036,43	13.256.036,43	0,00%	2,404%					

(*)

Handwritten signatures and stamps:
- "Alexandre Roberto S. Pereira" (signature)
- "Coordenador de Investimentos" (stamp)
- "18/06/2020" (date)
- "Res: 4604/17" (stamp)
- "Res: 4695/18" (stamp)

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2020—aos vinte e cinco dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 19/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-6,51	-6,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,20	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	1,75
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,76	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,6368	4,7948
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,5687	4,7284
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,3076	4,4738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	3,5303	3,7134
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	2,2417	2,3982
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –24/06/2020	2020	Redução	0,7982	0,7237
Ibovespa	24/06/2020	2020	Redução	95.547	94.377
Risco Brasil (JP Morgan)	22/06/2020	2020	Elevação	367	375
Posição dos Investimentos	Abr/20–Mai/20	2020	em Mil	529.408	540.406

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 no 504 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 94.377 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 554.013M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Maio/2020 da LDB Consultoria. Como consta na Ata 14/2020 decidimos temporariamente por manter os recursos de repasses previdenciários em conta corrente para proteção dos impactos negativos do mercado de crédito privado no fundo Santander DI Institucional e dado o recente credenciamento do fundo Santander Soberano DI, sem a composição desses créditos em sua carteira de investimentos, optamos pela migração dos valores do fundo Institucional para o fundo Soberano. Delibera o Comitê que todos os montantes que ingressarem no Instituto sejam direcionados ao fundo

Santander FIC Soberano RF REF DI. Participaram remotamente da reunião as Srs. Alexandre Sabanai, Suzana Vescovi, Novoa e Fátima Sorbello da Perfin Asset Management. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com 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
045/2020	25/06/2020	TOTAL	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
046/2020	25/06/2020	35.804.857,51	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI (CONTA 3)
047/2020	25/06/2020	120.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

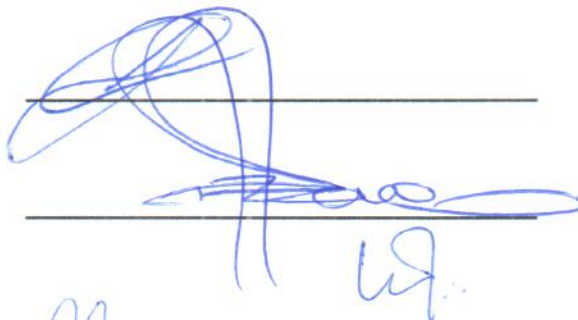
Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira



Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 26/2020

1 mensagem

➔ **wilson carrasco** <wilson.paschoal@uol.com.br>
 Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

26 de junho de 2020 15:19

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>

Enviada: 2020/06/26 15:09:12

Para: clayfs@yahoo.com.br, wilson.paschoal@uol.com.br, daniel_bertioga@hotmail.com, jean@bertprev.sp.gov.br

Assunto: ATA 26/2020

Boa tarde!

Segue Ata 26/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2020—aos vinte e cinco dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 19/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-6,51	-6,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,20	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	1,75
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,76	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,6368	4,7948
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,5687	4,7284

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -24/06/2020	2020	Elevação	4,3076	4,4738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -24/06/2020	2020	Elevação	3,5303	3,7134
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -24/06/2020	2020	Elevação	2,2417	2,3982
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -24/06/2020	2020	Redução	0,7982	0,7237
Ibovespa	24/06/2020	2020	Redução	95.547	94.377
Risco Brasil (JP Morgan)	22/06/2020	2020	Elevação	367	375
Posição dos Investimentos	Abr/20-Mai/20	2020	em Mil	529.408	540.406

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 no 504 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 94.377 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 554.013M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Maio/2020 da LDB Consultoria. Como consta na Ata 14/2020 decidimos temporariamente por manter os recursos de repasses previdenciários em conta corrente para proteção dos impactos negativos do mercado de crédito privado no fundo Santander DI Institucional e dado o recente credenciamento do fundo Santander Soberano DI, sem a composição desses créditos em sua carteira de investimentos, optamos pela migração dos valores do fundo Institucional para o fundo Soberano. Delibera o Comitê que todos os montantes que ingressarem no Instituto sejam direcionados ao fundo Santander FIC Soberano RF REF DI. Participaram remotamente da reunião as Srs. Alexandre Sabanai, Suzana Vescovi, Novoa e Fátima Sorbello da Perfin Asset Management. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com 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
045/2020	25/06/2020	TOTAL	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
046/2020	25/06/2020	35.804.857,51	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI (CONTA 3)
047/2020	25/06/2020	120.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 26/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

26 de junho de 2020 15:08

Para: clayfs@yahoo.com.br, wilson.paschoal@uol.com.br, daniel_bertioga@hotmail.com, jean@bertprev.sp.gov.br

Boa tarde!

Segue Ata 26/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2020—aos vinte e cinco dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 19/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-6,51	-6,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,20	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	1,75
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,76	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,6368	4,7948
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,5687	4,7284
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,3076	4,4738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	3,5303	3,7134
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	2,2417	2,3982
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –24/06/2020	2020	Redução	0,7982	0,7237
Ibovespa	24/06/2020	2020	Redução	95.547	94.377
Risco Brasil (JP Morgan)	22/06/2020	2020	Elevação	367	375
Posição dos Investimentos	Abr/20–Mai/20	2020	em Mil	529.408	540.406

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 no 504 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 94.377 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 554.013M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Maio/2020 da LDB Consultoria. Como consta na Ata 14/2020 decidimos temporariamente por manter os recursos de repasses previdenciários em conta corrente para proteção dos impactos negativos do mercado de crédito privado no fundo Santander DI Institucional e dado o recente credenciamento do fundo Santander Soberano DI, sem a composição desses créditos em sua carteira de investimentos, optamos pela migração dos valores do fundo Institucional para o fundo Soberano. Delibera o Comitê que todos os montantes que ingressarem no Instituto sejam direcionados ao fundo Santander FIC Soberano RF REF DI. Participaram remotamente da reunião as Srs. Alexandre Sabanai, Suzana Vescovi, Novoa e Fátima Sorbello da Perfin Asset Management. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com 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
045/2020	25/06/2020	TOTAL	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
046/2020	25/06/2020	35.804.857,51	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI (CONTA 3)
047/2020	25/06/2020	120.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

 **clayton faria schmidt** <clayfs@yahoo.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

26 de junho de 2020 15:41

Boa tarde,
De acordo,
Clayton Faria Schmidt

Em sexta-feira, 26 de junho de 2020 15:09:10 BRT, MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Boa tarde!

Segue Ata 26/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2020—aos vinte e cinco dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 19/06/2020, mercedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-6,51	-6,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,20	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	1,75
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,76	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,6368	4,7948
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,5687	4,7284
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,3076	4,4738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	3,5303	3,7134
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	2,2417	2,3982
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –24/06/2020	2020	Redução	0,7982	0,7237
Ibovespa	24/06/2020	2020	Redução	95.547	94.377
Risco Brasil (JP Morgan)	22/06/2020	2020	Elevação	367	375
Posição dos Investimentos	Abr/20–Mai/20	2020	em Mil	529.408	540.406

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 no 504 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 94.377 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 554.013M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Maio/2020 da LDB Consultoria. Como consta na Ata 14/2020 decidimos temporariamente por manter os recursos de repasses previdenciários em conta corrente para proteção dos impactos negativos do mercado de crédito privado no fundo Santander DI Institucional e dado o recente credenciamento do fundo Santander Soberano DI, sem a composição desses créditos em sua carteira de investimentos, optamos pela migração dos valores do fundo Institucional para o fundo Soberano. Delibera o Comitê que todos os montantes que ingressarem no Instituto sejam direcionados ao fundo Santander FIC Soberano RF REF DI. Participaram remotamente da reunião as Srs. Alexandre Sabanai, Suzana Vescovi, Novoa e Fátima Sorbello da Perfin Asset Management. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da

crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com 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
045/2020	25/06/2020	TOTAL	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
046/2020	25/06/2020	35.804.857,51	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI (CONTA 3)
047/2020	25/06/2020	120.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

 José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

26 de junho de 2020 16:03

Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>, "clayfs@yahoo.com.br" <clayfs@yahoo.com.br>, "wilson.paschoal@uol.com.br" <wilson.paschoal@uol.com.br>, "jean@bertprev.sp.gov.br" <jean@bertprev.sp.gov.br>

Boa tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: sexta-feira, 26 de junho de 2020 13:08

Para: clayfs@yahoo.com.br <clayfs@yahoo.com.br>; wilson.paschoal@uol.com.br <wilson.paschoal@uol.com.br>; daniel_bertioga@hotmail.com <daniel_bertioga@hotmail.com>; jean@bertprev.sp.gov.br <jean@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 26/2020

Boa tarde!

Segue Ata 26/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2020—aos vinte e cinco dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, 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, o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade 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 19/06/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/05/20 a 17/06/20	2020	Redução	3,00%	2,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-6,51	-6,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,20	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,25	1,75
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,76	1,76
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,6368	4,7948
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,5687	4,7284
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	4,3076	4,4738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	3,5303	3,7134
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –24/06/2020	2020	Elevação	2,2417	2,3982
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –24/06/2020	2020	Redução	0,7982	0,7237
Ibovespa	24/06/2020	2020	Redução	95.547	94.377
Risco Brasil (JP Morgan)	22/06/2020	2020	Elevação	367	375
Posição dos Investimentos	Abr/20–Mai/20	2020	em Mil	529.408	540.406

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 no 504 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 94.377 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/06/2020 indica o patrimônio de R\$ 554.013M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Maio/2020 da LDB Consultoria. Como consta na Ata 14/2020 decidimos temporariamente por manter os recursos de repasses previdenciários em conta corrente para proteção dos impactos negativos do mercado de crédito privado no fundo Santander DI Institucional e dado o recente credenciamento do fundo Santander Soberano DI, sem a composição desses créditos em sua carteira de investimentos, optamos pela migração dos valores do fundo Institucional para o fundo Soberano. Delibera o Comitê que todos os montantes que ingressarem no Instituto sejam direcionados ao fundo Santander FIC Soberano RF REF DI. Participaram remotamente da reunião as Srs. Alexandre Sabanai, Suzana Vescovi, Novoa e Fátima Sorbello da Perfin Asset Management. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e APRs com 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
045/2020	25/06/2020	TOTAL	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 3)
046/2020	25/06/2020	35.804.857,51	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI (CONTA 3)
047/2020	25/06/2020	120.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REF DI (CONTA 1)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



Relatório Semanal de Investimentos

25 de junho de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 15/06/2020	Posição 22/06/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 -R\$ 22.522.261,03	27,37% -3,91%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	551.475.321,46	554.013.359,81	0,46%	100,0%	100,00%	Nível II			
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federais	163.608.711,26	161.856.718,71	-1,07%	29,22%	100,00%	100,00%			Artigo 2, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	163.608.711,26	161.856.718,71	-1,07%	29,22%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	109.123.909,95	109.024.000,38	-0,09%	19,68%					Artigo 2, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.439.515,76	16.458.098,87	0,11%	2,971%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.178.618,20	16.216.397,15	0,23%	2,927%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.643.829,98	30.558.973,11	-0,28%	5,516%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.606.680,80	16.527.542,40	-0,48%	2,983%	100,00%	100,00%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.888.245,00	19.878.287,00	-0,05%	3,588%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.367.020,21	9.384.701,85	0,19%	1,694%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	126.050.979,23	125.980.907,98	-0,06%	22,74%					Artigo 2, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.123.825,16	25.094.857,51	-0,12%	4,530%	40,00%	50,00%			
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	100.927.154,07	100.886.050,47	-0,04%	18,210%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.929.958,45	3.931.361,95	0,04%	0,71%					Artigo 2, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.929.958,45	3.931.361,95	0,04%	0,710%	5,00%	15,00%			
	Fundos de Investimentos em Ações	129.702.251,39	134.160.859,61	3,44%	24,22%					Artigo 2, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	18.156.721,59	18.830.565,66	3,71%	3,399%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	16.125.165,30	16.862.272,72	4,57%	3,044%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.676.070,14	6.891.875,89	3,23%	1,244%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	42.796.951,11	44.071.984,41	2,98%	7,955%	20,00%	30,00%			
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	35.318.985,99	36.473.490,46	3,27%	6,584%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.439.801,95	7.730.226,77	3,90%	1,395%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.188.555,31	3.300.443,70	3,51%	0,596%					
	Fundo de Investimento em Participações	19.059.511,18	19.059.511,18	0,00%	3,44%					Artigo 2, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.803.474,75	5.803.474,75	0,00%	1,048%	5,00%	5,00%			
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.256.036,43	13.256.036,43	0,00%	2,393%					

(*)

Alexandre Nogueira
Coord. Adm. e Financeira
Reg.: 019/2019



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
MAIO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 10/06/2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado.

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

73,75%

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	16,22	1,46	-5,31	107.536.147,98	19,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,66	3,18	2,69	10.395.533,25	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	23,59	0,10	-11,95	11.710.410,61	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,06	0,60	-9,84	8.811.550,23	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,14	2,52	2,93	21.976.987,92	4,07
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		14,95	1,56	-4,57	160.430.629,99	29,69

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	6,13	2,50	2,85	16.417.295,56	3,04	341.154.566,97	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	2,34	1,25	0,64	16.105.334,29	2,98	676.970.933,69	2,38
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,08	1,07	0,79	30.446.645,54	5,63	10.653.642.517,78	0,29
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	13,44	1,76	-2,03	16.322.410,00	3,02	65.313.192,39	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,64	3,15	2,59	19.852.651,00	3,67	215.573.327,31	9,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,14	1,83	1,41	9.332.267,16	1,73	883.847.989,19	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,73	1,86	1,02	108.476.603,55	20,07		

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	0,26	0,22	0,86	25.096.228,29	4,64	2.557.300.343,58	0,98

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 ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,92	0,54	1,82	100.625.302,83	18,62	5.202.369.354,06	1,93
		Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a	1,50	0,48	1,63	125.721.531,12	23,26		

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	4,46	2,17	1,68	3.911.985,22	0,72	594.877.546,04	0,66
		Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b	4,46	2,17	1,68	3.911.985,22	0,72		
		Renda Fixa	8,11	1,30	-1,14	398.540.749,88	73,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

26,25%

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	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	44,35	9,33	-25,16	17.104.917,84	3,17	752.971.612,41	2,27
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	39,51	7,88	-19,75	6.450.559,51	1,19	77.086.923,39	8,37
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,14	7,94	-23,23	33.555.363,44	6,21	700.479.562,12	4,79
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,23	5,79	-26,59	15.465.340,43	2,86	1.070.014.738,46	1,45
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	47,20	8,30	-22,94	7.047.376,58	1,30	142.633.153,83	4,94
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,04	10,28	-16,87	40.090.166,77	7,42	1.808.642.265,33	2,22
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	38,32	7,50	-20,43	3.092.040,69	0,57	768.284.939,45	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,58	8,61	-21,75	122.805.765,26	22,72		

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	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY IL.	50,39	-0,10	2,04	5.803.474,75	1,07	41.180.726,38	14,09
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	48,02	0,00	0,00	13.256.036,43	2,45	211.433.794,53	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			27,69	-0,07	16,26	19.059.511,18	3,53		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,76	7,36	-18,34	141.865.276,44	26,25		
Total						540.406.026,32	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Pro-Gestão Nivel 2 Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	160.430.629,99	29,69	10,00	30,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	108.476.603,55	20,07	10,00	22,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	125.721.531,12	23,26	0,00	17,30	50,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.911.985,22	0,72	0,00	0,70	15,00	15,00
	Total Renda Fixa	398.540.749,88	73,75				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	122.805.765,26	22,72	0,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	19.059.511,18	3,53	0,00	3,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	141.865.276,44	26,25				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

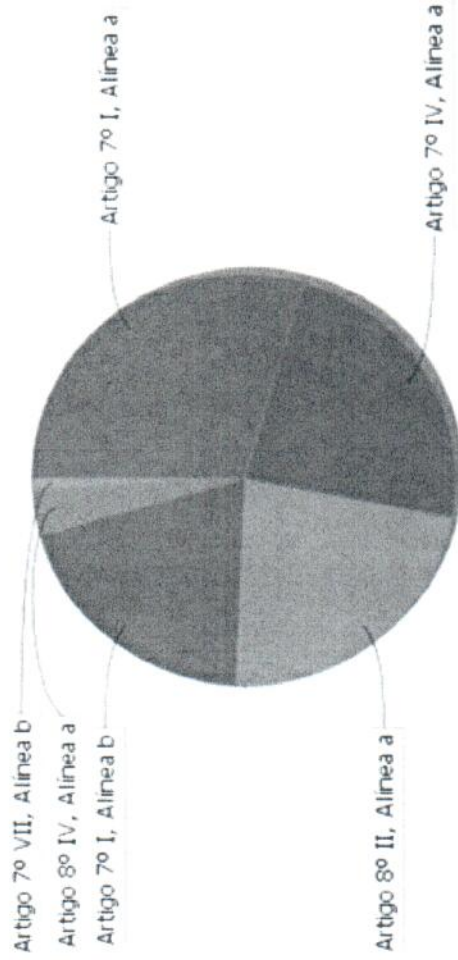
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,56 663,36	-4,57 -296,67	-5,73 -664,85	-3,06 -159,59	6,29 129,15	2.408.386,32	-7.945.048,72
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,86 789,92	1,02 66,49	-0,18 -20,72	2,19 114,14	9,04 185,62	1.982.828,30	1.115.495,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,48 201,75	1,63 105,87	1,01 117,27	1,98 103,38	6,88 141,32	595.289,81	2.052.289,52
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	2,17 921,51	1,68 109,44	0,52 60,89	2,80 146,12	8,29 170,12	83.198,77	64.785,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,61 0,04	-21,75 2,67	-17,38 -1,28	-15,34 3,90	-1,62 8,31	9.736.873,05	-33.828.779,34
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,07 -8,64	16,26 40,68	-2,02 14,08	17,78 37,03	19,71 29,64	-13.698,18	2.758.038,61
						14.792.878,07	-35.783.218,76

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	252.114.144,46	46,65	252.114.144,46	46,65
de 31 a 364 dias	48.985.682,21	9,06	301.099.826,67	55,72
acima de 365 dias	239.306.199,65	44,28	540.406.026,32	100,00

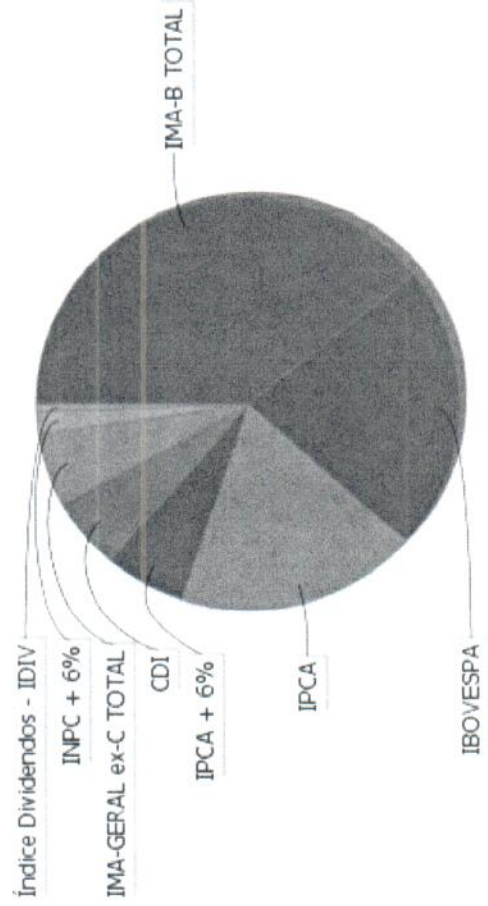
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alinea a: 29.69%
- Artigo 7º IV, Alinea a: 23.26%
- Artigo 8º II, Alinea a: 22.72%
- Artigo 7º I, Alinea b: 20.07%
- Artigo 8º IV, Alinea a: 3.53%
- Artigo 7º VII, Alinea b: 0.72%

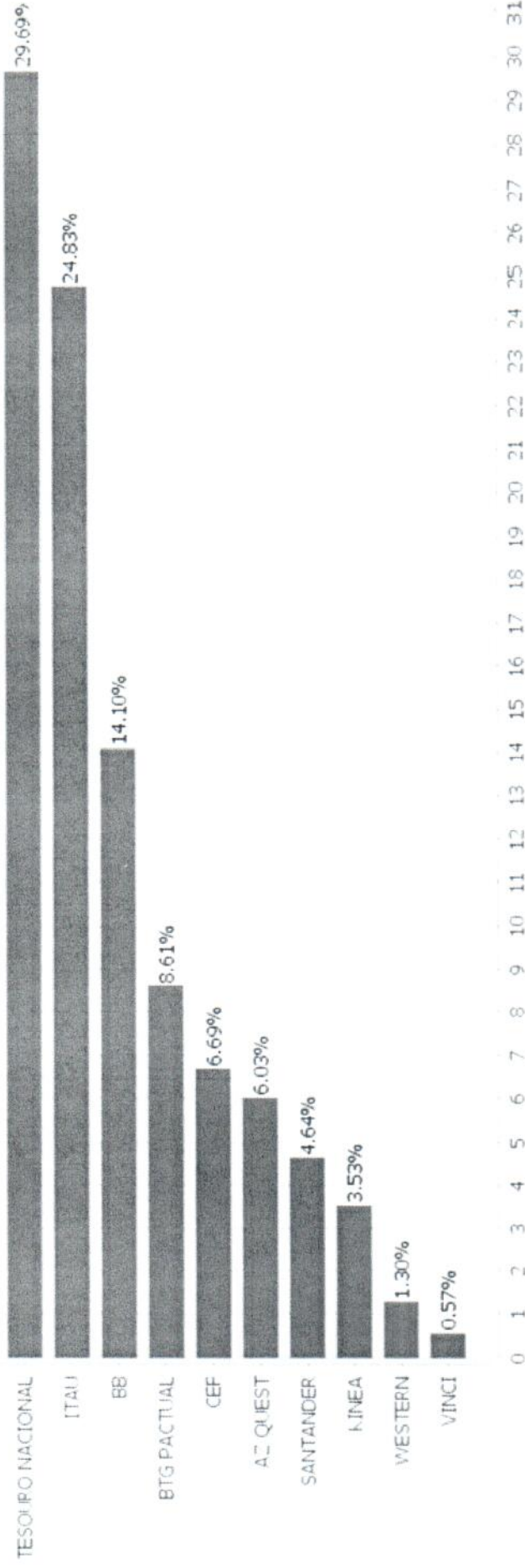
Alocação Por Estratégia



- IMA-B TOTAL: 39.36%
- IBOVESPA: 22.15%
- IPCA: 18.62%
- IPCA + 6%: 6.21%
- CDI: 5.72%
- IMA-GERAL ex-C TOTAL: 5.63%
- INPC + 6%: 1.73%
- Índice Dividendos - IDIV: 0.57%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	-6,12
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	2,18
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	-8,30
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

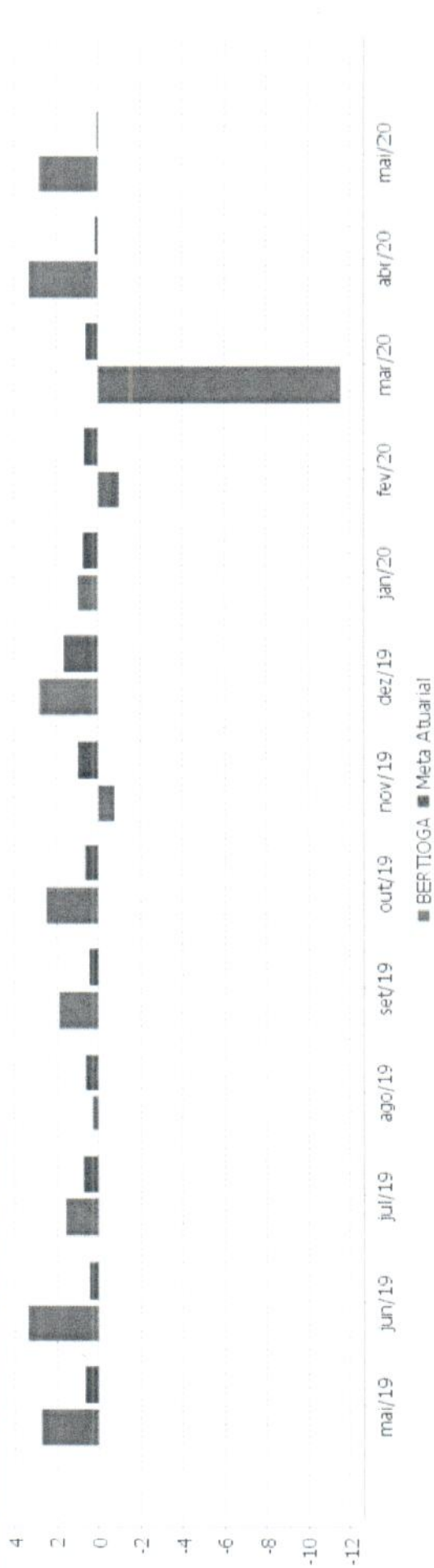
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	24	58,54	03 meses	-6,08	0,79	-6,87	27,54
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	41,46	06 meses	-3,48	3,86	-7,34	20,09
			12 meses	5,32	7,92	-2,60	14,54
			24 meses	25,22	19,70	5,52	11,51
			36 meses	42,25	30,41	11,84	10,89
			Desde 30/12/2016	49,65	35,45	14,21	11,35
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
NTN-B 150824	3,18	2,69	1,13	4,24	12,45	32,73	45,07
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,66	6,33	5,45	5,94	5,76	0,73	1,57
NTN-B 150545	0,60	-9,84	-9,79	-7,07	2,83	36,77	46,35
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92	-6,21	-5,47	-5,36	-3,85	4,77	2,84
NTN-B 150850	0,10	-11,95	-11,37	-8,82	1,52	41,34	50,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,42	-8,31	-7,05	-7,11	-5,16	9,35	6,65
NTN-B 150535	1,46	-5,31	-6,70	-4,13	5,51	34,72	45,20
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-1,67	-2,38	-2,42	-1,17	2,73	1,70
NTN-B 150523	2,52	2,93	1,44	4,45	11,73	31,08	43,41
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,00	6,57	5,76	6,15	5,05	-0,91	-0,10
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,54	1,82	1,22	2,17	7,84	19,42	32,39
Var. IPCA p.p.	0,68	1,74	1,60	0,94	5,72	12,54	22,46
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,22	0,86	0,21	1,24	4,01	10,63	19,17
% do CDI	92,06	56,14	23,94	64,43	82,34	92,00	95,39
BB CRED PRIV III	2,17	1,68	0,52	2,80	8,29	23,00	37,20
Var. IPCA + 6% p.p.	1,85	-0,78	-0,53	-1,35	0,06	2,97	6,42
BB PREV RF VII	1,25	0,64	0,03	1,57	6,31	18,52	30,05
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,27	4,28	4,35	3,27	-0,37	-13,48	-13,46
BB PREV ALOC FIC	1,07	0,79	-0,15	1,76	7,59	22,37	33,47
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,10	-0,00	0,00	0,05	0,17	0,40	0,42
BB PREV RF IPCA	2,50	2,85	1,39	4,35	11,52	30,47	42,47
Var. IPCA + 6% p.p.	2,18	0,39	0,33	0,20	3,29	10,43	11,70
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	1,76	-2,03	-3,76	-0,96	7,56	32,01	35,65
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24	1,60	0,56	0,75	0,88	0,02	-7,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,83	1,41	0,43	2,52	8,26	29,72	41,51
Var. INPC + 6% p.p.	1,28	-1,39	-1,06	-2,04	-0,26	9,21	11,62
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,15	2,59	1,07	4,12	12,18	32,11	36,80
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,64	6,23	5,39	5,82	5,49	0,11	-6,71
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,06	17,74	-5,62	20,94	35,22	31,35	
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,38	15,27	-6,68	16,79	26,99	11,31	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,10	2,04	0,33	1,51	-6,52	-35,39	38,93
% do CDI	-43,10	132,26	38,81	78,47	-133,77	-306,41	193,66
WA ASSET VALUATION FIA	8,30	-22,94	-14,84	-16,68	-5,85	13,93	32,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IBOVESPA p.p.	-0,26	1,48	1,26	2,56	4,07	0,05	-7,29
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,28	-16,87	-12,27	-10,89	3,46	41,18	67,32
Var. IBOVESPA p.p.	1,71	7,55	3,83	8,35	13,39	27,31	27,94
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,33	-25,16	-21,39	-19,52	-9,51	10,88	50,55
Var. IBOVESPA p.p.	0,76	-0,73	-5,30	-0,27	0,41	-2,99	11,18
FIC DE FIE M AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	7,50	-20,43	-16,30	-13,65	-1,18	31,96	43,26
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,50	4,65	2,56	3,95	4,33	2,42	-2,33
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,79	-26,59	-26,64	-18,65	4,15	30,60	76,97
Var. IBOVESPA p.p.	-2,78	-2,17	-10,55	0,60	14,07	16,72	37,60
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	7,94	-23,23	-17,31	-16,88	-5,23	19,25	44,26
Var. IBOVESPA p.p.	-0,63	1,19	-1,22	2,37	4,69	5,37	4,88
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	7,88	-19,75	-14,90	-13,37	-2,52	25,23	34,98
Var. IBOVESPA p.p.	-0,69	4,68	1,20	5,87	7,41	11,35	-4,40
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	3,59	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	0,80	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,93	6,51	14,67	19,57
SELIC	0,24	1,54	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	-0,07	1,44	0,34	2,94	5,94	15,29	23,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,01	1,83	0,58	3,42	6,95	17,51	26,83
IPCA + 5,5%	0,04	2,03	0,70	3,66	7,46	18,62	28,64
IPCA + 5,89%	0,07	2,18	0,79	3,85	7,85	19,50	30,06
IPCA + 6%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46
INPC + 4%	0,06	1,66	0,67	3,24	6,12	15,62	22,31
INPC + 6%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45

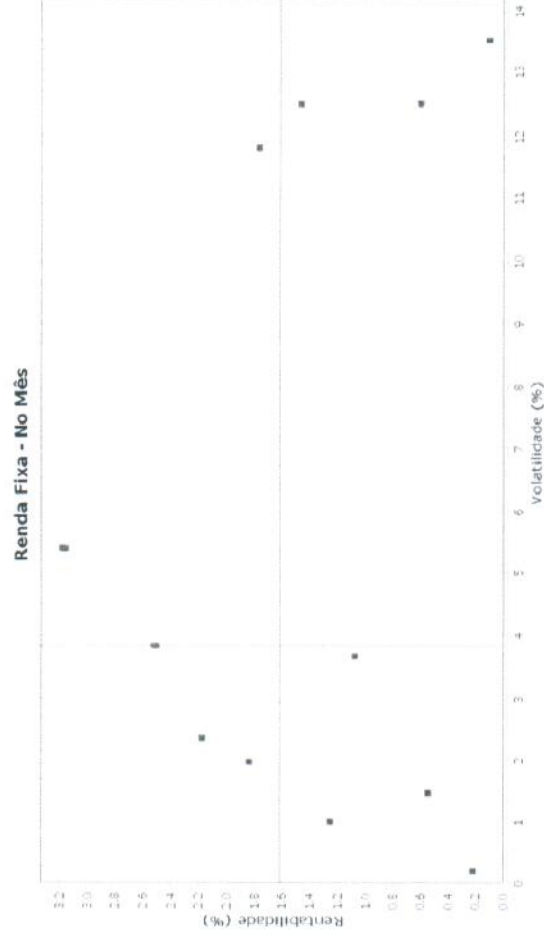
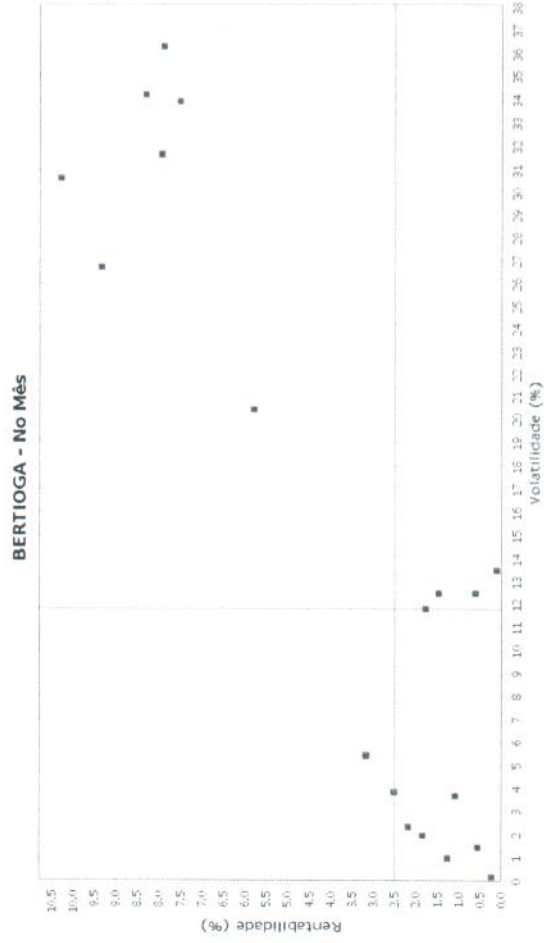
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
15/05/2020	BB PREV RF IPCA	0,00	412.399,12	179.330,22586800	2,2996631940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,20	0,03	0,22	25.096.228,29	4,64
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,00	0,17	1,25	16.105.334,29	2,98
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,47	0,18	0,54	100.625.302,83	18,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,97	0,30	1,83	9.332.267,16	1,73
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	2,35	0,35	2,17	3.911.985,22	0,72
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	3,66	0,43	1,07	30.446.645,54	5,63
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	3,83	0,52	2,50	16.417.295,56	3,04
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	3,84	0,52	2,52	21.976.987,92	4,07
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	0,71	3,15	19.852.651,00	3,67
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	5,39	0,71	3,18	10.395.533,25	1,92
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	11,81	1,31	1,76	16.322.410,00	3,02
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	12,51	1,37	1,46	107.536.147,98	19,90
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	12,52	1,33	0,60	8.811.550,23	1,63
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	13,53	1,41	0,10	11.710.410,61	2,17
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,42	2,40	5,79	15.465.340,43	2,86
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,70	3,21	9,33	17.104.917,84	3,17
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,63	3,66	10,28	40.090.166,77	7,42
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	31,63	3,66	7,94	33.555.363,44	6,21
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	33,92	3,88	7,50	3.092.040,69	0,57
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	34,19	3,94	8,30	7.047.376,58	1,30
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	36,32	4,14	7,88	6.450.559,51	1,19



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
JUNHO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 14.07.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 72,90%

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	16,23	2,65	-2,80	110.382.012,33	19,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,58	1,26	3,98	10.526.232,50	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	23,69	3,44	-8,92	12.112.672,92	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,14	2,79	-7,33	9.057.052,20	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,05	1,16	4,13	22.232.221,48	3,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		14,95	2,42	-2,26	164.310.191,43	28,86

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	6,04	1,14	4,03	16.605.011,16	2,92	345.055.333,30	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	2,30	0,99	1,64	16.265.147,82	2,86	683.688.528,70	2,38
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	6,05	0,95	1,75	30.735.490,39	5,40	10.783.491.196,95	0,29
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	13,44	2,87	0,78	16.791.021,20	2,95	67.188.321,04	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,57	1,24	3,86	20.097.948,00	3,53	218.237.042,96	9,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,09	1,09	2,51	9.433.931,57	1,66	893.476.505,39	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,68	1,34	2,38	109.928.550,14	19,31		

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	0,32	0,02	0,88	0,00	0,00	1.849.278.570,83	0,00

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	1,67	0,44	2,27	101.063.863,45	17,75	5.170.951.886,47	1,95
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,07	0,02	0,02	35.812.946,42	6,29	6.357.322.015,05	0,56
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,33	0,35	1,99	136.876.809,87	24,04		

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	4,44	0,98	2,68	3.950.204,00	0,69	600.689.300,61	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,44	0,98	2,68	3.950.204,00	0,69		
Renda Fixa			8,07	1,45	0,30	415.065.755,44	72,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,10%

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	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	44,55	9,88	-17,76	18.794.318,04	3,30	806.010.588,17	2,33
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	39,74	6,85	-14,25	6.892.650,40	1,21	83.179.459,99	8,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	43,37	8,62	-16,61	36.447.311,05	6,40	769.821.540,22	4,73
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	45,57	8,63	-20,26	16.800.659,65	2,95	1.154.678.354,43	1,46
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	47,42	9,58	-15,55	7.722.615,91	1,36	150.780.206,06	5,12
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	45,13	10,27	-8,33	44.208.064,48	7,76	2.091.503.187,63	2,11
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	4,58	-16,79	3.233.747,37	0,57	799.344.501,83	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,77	9,20	-14,55	134.099.366,90	23,55		

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	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	50,19	-0,12	1,91	5.796.472,83	1,02	41.131.041,63	14,09
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	48,47	0,00	0,00	14.365.697,14	2,52	229.132.883,92	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			28,13	5,79	22,99	20.162.169,97	3,54		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			37,93	8,74	-11,21	154.261.536,87	27,10		
Total						569.327.292,31	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	164.310.191,43	28,86	10,00	30,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	109.928.550,14	19,31	10,00	22,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	136.876.809,87	24,04	0,00	17,30	50,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.950.204,00	0,69	0,00	0,70	15,00	15,00
	Total Renda Fixa	415.065.755,44	72,90				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	134.099.366,90	23,55	0,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	20.162.169,97	3,54	0,00	3,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	154.261.536,87	27,10				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

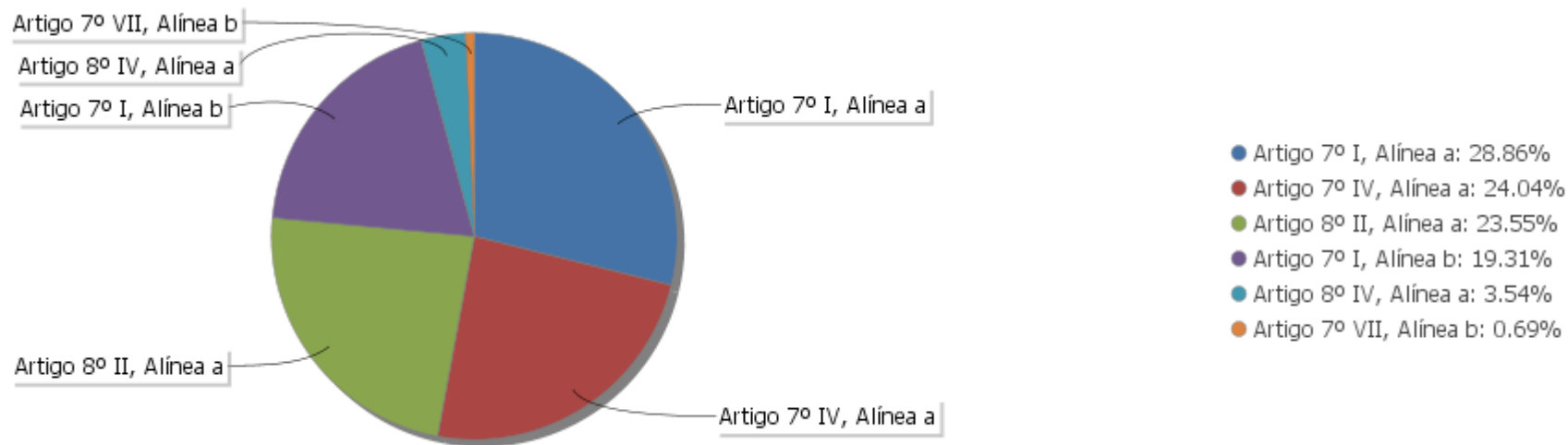
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	2,42 1.138,91	-2,26 -128,67	5,89 801,47	-2,26 -128,67	4,33 94,17	3.879.561,44	-4.065.487,28
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,34 630,39	2,38 135,39	4,03 548,66	2,38 135,39	7,92 171,98	1.451.946,59	2.567.442,02
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,35 166,81	1,99 113,37	0,96 130,59	1,99 113,37	5,16 112,12	451.817,19	2.504.106,71
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,98 460,12	2,68 152,61	3,62 491,95	2,68 152,61	7,94 172,39	38.218,78	103.004,52
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,20 0,44	-14,55 3,25	34,10 3,92	-14,55 3,25	2,50 8,36	11.293.601,64	-22.535.177,70
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,79 -2,97	22,99 40,79	5,63 -24,55	22,99 40,79	26,97 32,82	1.102.658,79	3.860.697,40
						18.217.804,43	-17.565.414,33

Análise de Liquidez

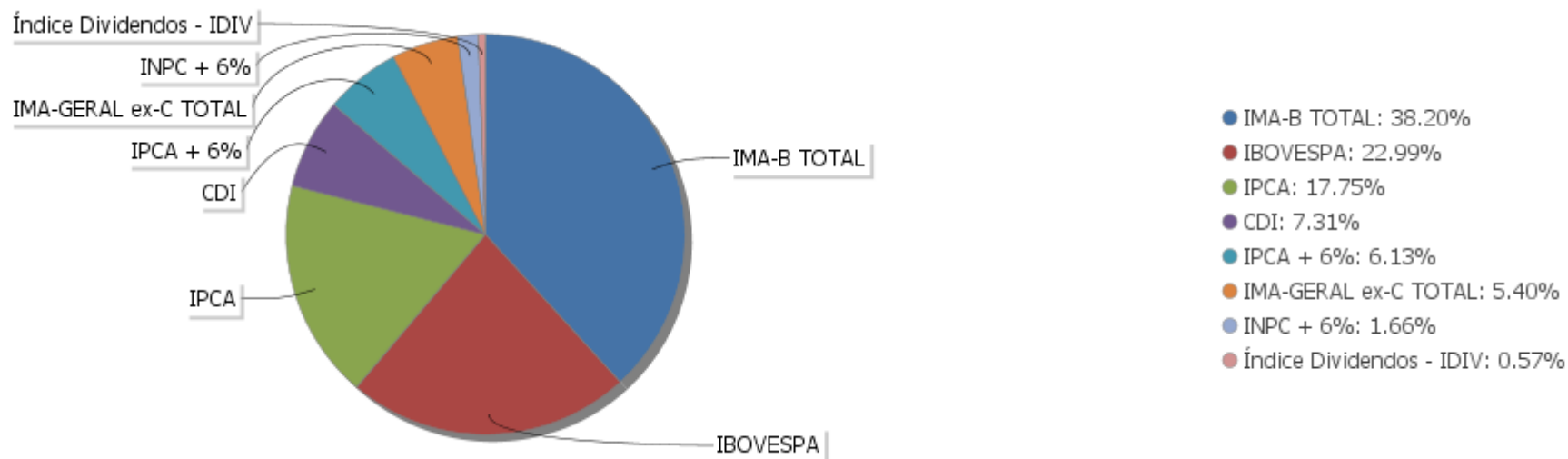
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	271.060.876,51	47,61	271.060.876,51	47,61
de 31 a 364 dias	53.238.284,68	9,35	324.299.161,19	56,96
acima de 365 dias	245.028.131,12	43,04	569.327.292,31	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

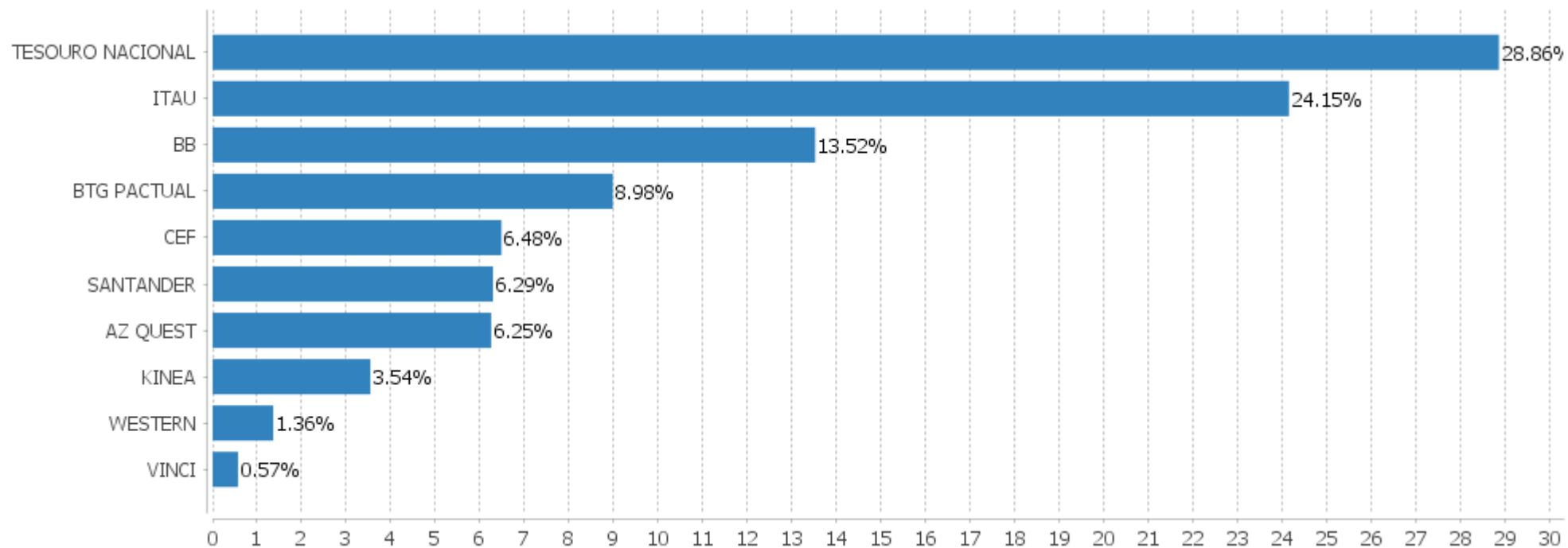


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36							-2,96
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,93
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62							-5,90
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

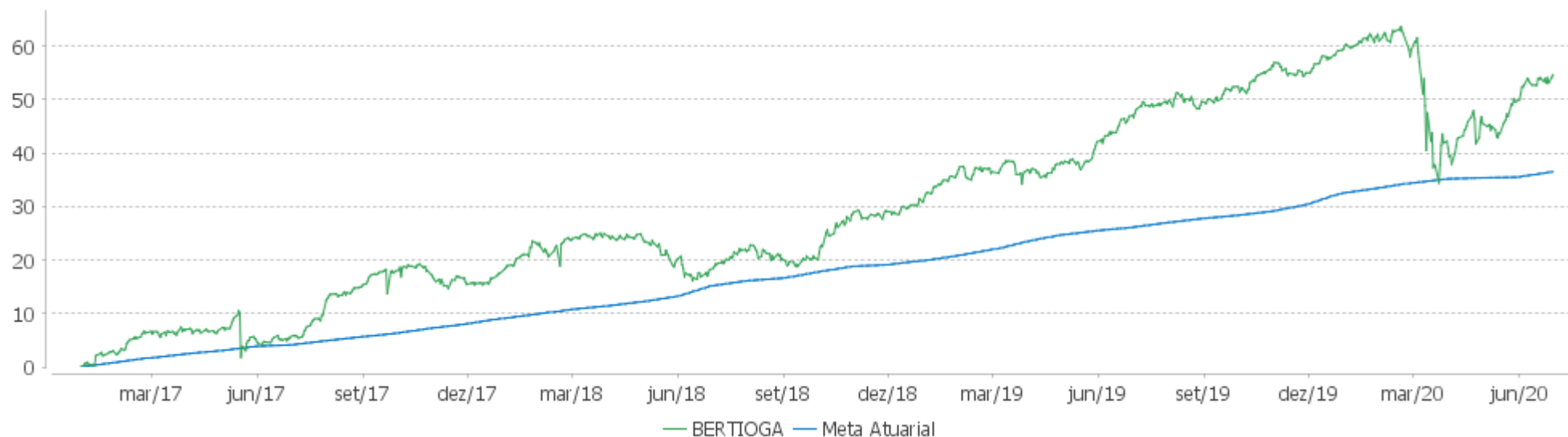
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

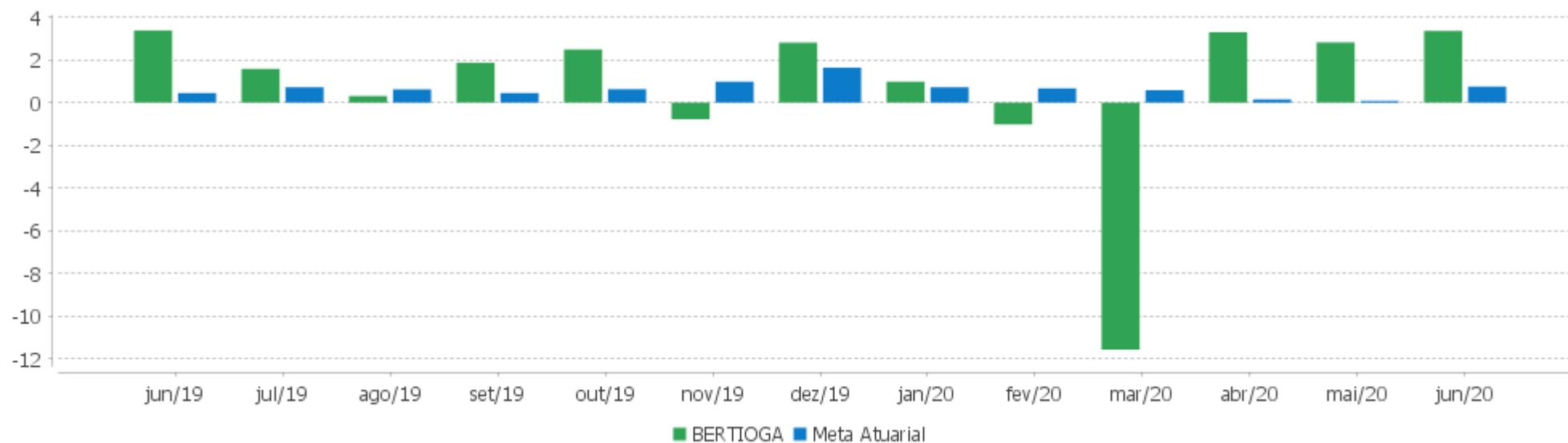
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	25	59,52	03 meses	9,79	0,96	8,83	12,57
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	40,48	06 meses	-2,96	2,93	-5,90	20,28
			12 meses	5,30	8,23	-2,93	14,56
			24 meses	30,84	18,50	12,34	11,43
			36 meses	46,43	31,04	15,39	10,93
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	Desde 30/12/2016	54,69	36,45	18,24	11,27
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,79	3,98 5,64	5,22 0,26	3,98 5,64	10,54 5,59	34,38 -0,75	46,64 0,44
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,79 0,74	-7,33 -5,67	5,59 0,63	-7,33 -5,67	0,13 -4,82	42,49 7,36	51,24 5,04
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,44 1,39	-8,92 -7,26	6,15 1,19	-8,92 -7,26	-0,97 -5,92	48,46 13,33	55,82 9,62
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,65 0,60	-2,80 -1,14	6,22 1,26	-2,80 -1,14	3,60 -1,35	39,40 4,27	48,80 2,60
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 -0,89	4,13 5,79	4,58 -0,38	4,13 5,79	10,40 5,45	32,12 -3,01	44,82 -1,39
BB CRED PRIV III Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 0,23	2,68 -0,31	3,62 2,63	2,68 -0,31	7,94 -0,35	24,05 5,49	37,24 6,13
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,06	1,64 3,31	2,40 -2,56	1,64 3,31	6,28 1,33	19,00 -16,13	30,65 -15,55
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	1,14 0,40	4,03 1,04	4,52 3,54	4,03 1,04	10,18 1,90	31,61 13,04	43,87 12,76
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,87 0,82	0,78 2,44	6,25 1,29	0,78 2,44	6,75 1,80	37,14 2,01	39,13 -7,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,09 0,30	2,51 -0,74	3,28 2,05	2,51 -0,74	7,73 -0,79	29,33 10,58	42,34 12,11
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	3,86 5,52	5,15 0,19	3,86 5,52	10,27 5,33	33,75 -1,38	38,27 -7,93
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,44 0,18	2,27 2,17	1,12 1,55	2,27 2,17	5,62 3,49	19,25 13,67	31,68 21,48
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI % do CDI	0,20 92,55	1,64 93,20	0,68 92,54	1,64 93,20	4,37 94,97		
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do CDI	0,04 18,39	0,90 51,49	0,32 43,32	0,90 51,49	3,57 77,60	10,11 90,16	18,21 93,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	10,27 1,52	-8,33 9,47	41,67 11,49	-8,33 9,47	8,82 14,67	58,71 28,07	80,75 29,62
WA ASSET VALUATION FIA	9,58	-15,55	38,45	-15,55	-1,99	30,14	42,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,83	2,25	8,27	2,25	3,86	-0,49	-8,78
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,88	-17,76	33,78	-17,76	-3,83	27,38	65,07
Var. IBOVESPA p.p.	1,12	0,04	3,60	0,04	2,02	-3,26	13,95
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	4,58	-16,79	20,57	-16,79	-2,34	45,78	50,01
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,37	1,59	1,87	1,59	-2,18	-1,73	-10,56
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	8,63	-20,26	28,01	-20,26	7,24	45,66	93,56
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-2,45	-2,17	-2,45	13,09	15,02	42,44
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,62	-16,61	30,81	-16,61	-1,66	35,75	55,33
Var. IBOVESPA p.p.	-0,14	1,19	0,63	1,19	4,19	5,11	4,21
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	6,85	-14,25	25,30	-14,25	-0,72	40,37	41,82
Var. IBOVESPA p.p.	-1,90	3,56	-4,87	3,56	5,13	9,73	-9,31
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	8,37	27,60	8,26	27,60	47,27	98,55	
Var. IPCA + 6% p.p.	7,62	24,61	7,28	24,61	38,99	79,99	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,12	1,91	-0,37	1,91	-6,58	-35,37	38,53
% do CDI	-56,82	108,99	-50,48	108,99	-142,89	-315,41	198,68
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
Renda Variável							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
25/06/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	35.804.857,51	0,00	1.267.556,50218900	28,2471491000
25/06/2020	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,00	25.101.395,95	135.924,37477692	184,6717779000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

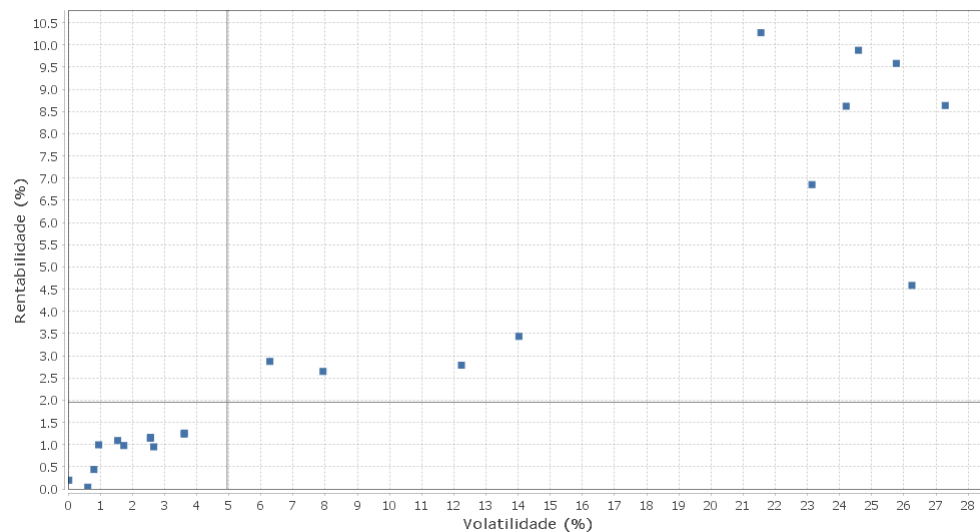
Rendimentos Realizados

Artigo	Ativo	Quantidade	Valor Aplicação	Valor Resgate	Rendimento
--------	-------	------------	-----------------	---------------	------------

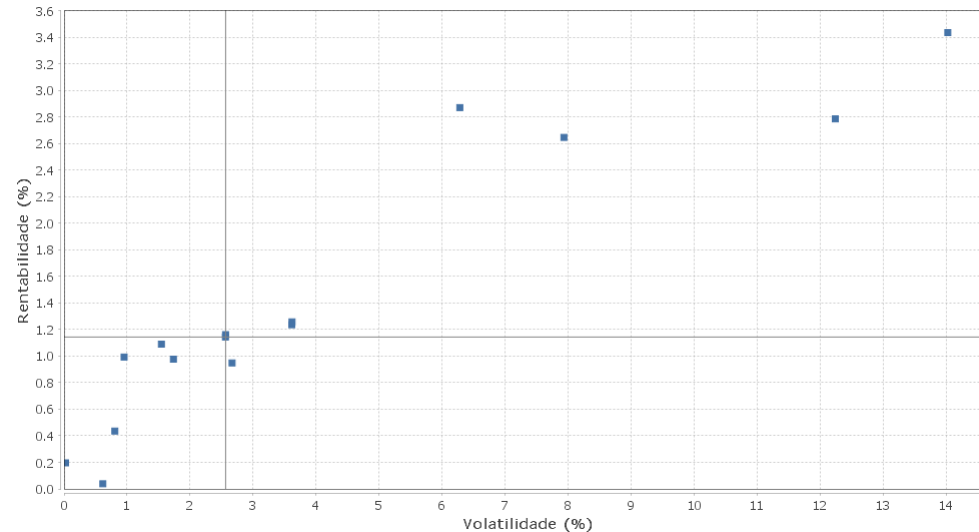
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

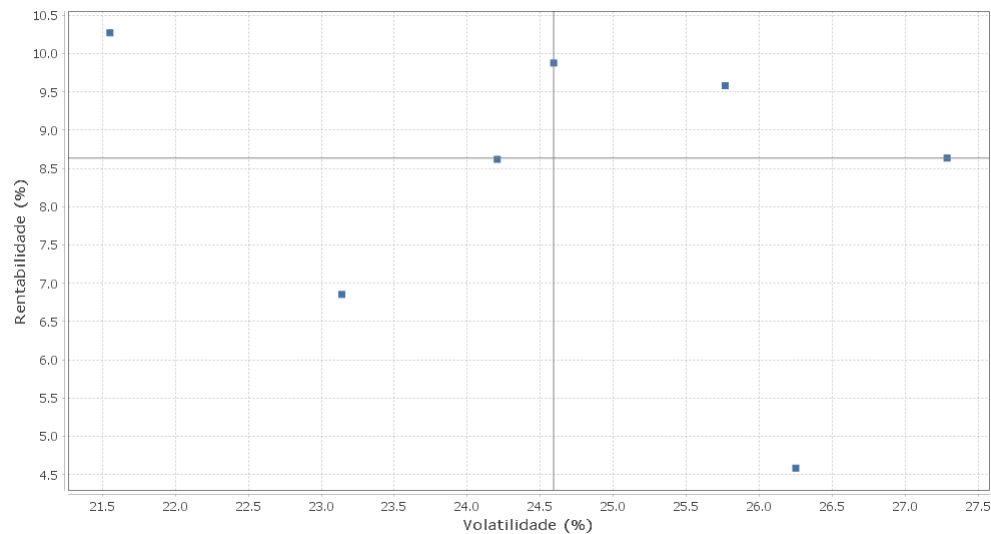
BERTIOGA - No Mês



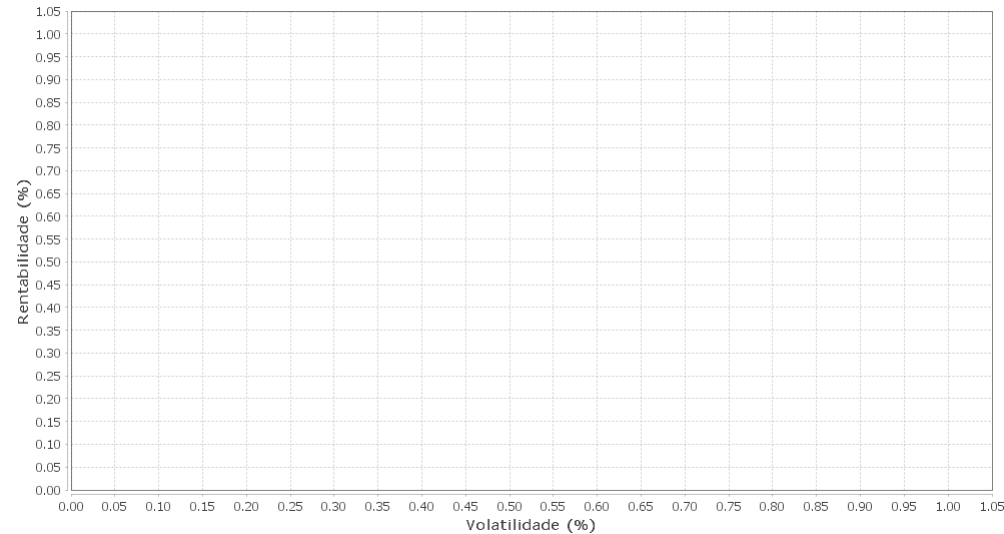
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,20	35.812.946,42	6,29
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,62	0,07	0,04	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,81	0,10	0,44	101.063.863,45	17,75
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,95	0,15	0,99	16.265.147,82	2,86
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,54	0,21	1,09	9.433.931,57	1,66
BB CRED PRIV III	Artigo 7º VII, Alínea b	1,74	0,23	0,98	3.950.204,00	0,69
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,56	0,32	1,14	16.605.011,16	2,92
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,56	0,32	1,16	22.232.221,48	3,90
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,67	0,32	0,95	30.735.490,39	5,40
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,61	0,43	1,24	20.097.948,00	3,53
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,62	0,43	1,26	10.526.232,50	1,85
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	6,28	0,79	2,87	16.791.021,20	2,95
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	7,93	0,95	2,65	110.382.012,33	19,39
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	12,24	1,40	2,79	9.057.052,20	1,59
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	14,03	1,61	3,44	12.112.672,92	2,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,55	2,70	10,27	44.208.064,48	7,76
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	23,14	2,71	6,85	6.892.650,40	1,21
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,20	2,90	8,62	36.447.311,05	6,40
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,59	3,00	9,88	18.794.318,04	3,30
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,77	3,11	9,58	7.722.615,91	1,36
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	26,25	2,93	4,58	3.233.747,37	0,57
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,29	3,22	8,63	16.800.659,65	2,95



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
Estado de São Paulo

“Nossa missão é garantir parte do seu futuro”

CONTROLE INTERNO BERTPREV

RELATÓRIO DE ATIVIDADES

EXERCÍCIO 2019



BERTIOGA – SP

JULHO/2020

COMPOSIÇÃO DA COMISSÃO DE CONTROLE INTERNO

KÁTIA HIDALGO DAIA

Presidente da Comissão de Controle Interno

MARCELA DE CAMARGO ALEAGI

Comissão de Controle Interno

PATRÍCIA RAMOS QUARESMA

Comissão de Controle Interno

Sumário

APRESENTAÇÃO	4
1. CONTROLE DA ÁREA ADMINISTRATIVA.....	4
1.1 COMPRAS, LICITAÇÕES E CONTRATOS	4
1.1.1 COMPRAS	4
1.1.2 LICITAÇÕES.....	7
1.1.3 CONTRATOS.....	8
1.2 RECURSOS HUMANOS.....	8
1.3 ALMOXARIFADO E BENS PATRIMONIAIS.....	10
1.4 TRANSPARÊNCIA.....	10
2. CONTROLE DA ÁREA CONTÁBIL E FINANCEIRA.....	10
2.1 EXECUÇÃO ORÇAMENTÁRIA.....	10
2.2 DEMONSTRAÇÕES CONTÁBEIS	11
2.3 EVOLUÇÃO PATRIMONIAL	11
2.4 CUSTEIO/TAXA ADM – REPASSES DO EXERCÍCIO.....	13
2.5 DESPESAS ADMINISTRATIVAS	14
2.6 IMPOSTOS E ENCARGOS SOCIAIS	15
2.7 ADIANTAMENTO DE VERBAS	15
3. CONTROLE DA ÁREA PREVIDENCIÁRIA	16
3.1 REPASSES PREVIDENCIÁRIOS	16
3.2 BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS.....	16
3.3 SERVIÇOS MÉDICOS	18
3.4 CÁLCULO ATUARIAL.....	18
4. CONSIDERAÇÕES FINAIS.....	18

APRESENTAÇÃO

O presente relatório tem a finalidade básica de materializar as ações de controle e resultados desta Autarquia no exercício de 2019. Neste documento estão registradas, de forma consolidada, as informações sobre as atividades desenvolvidas durante o exercício, assim como uma totalização dos dados mencionados bimestralmente em relatórios já apresentados e publicados no site.

1. CONTROLE DA ÁREA ADMINISTRATIVA

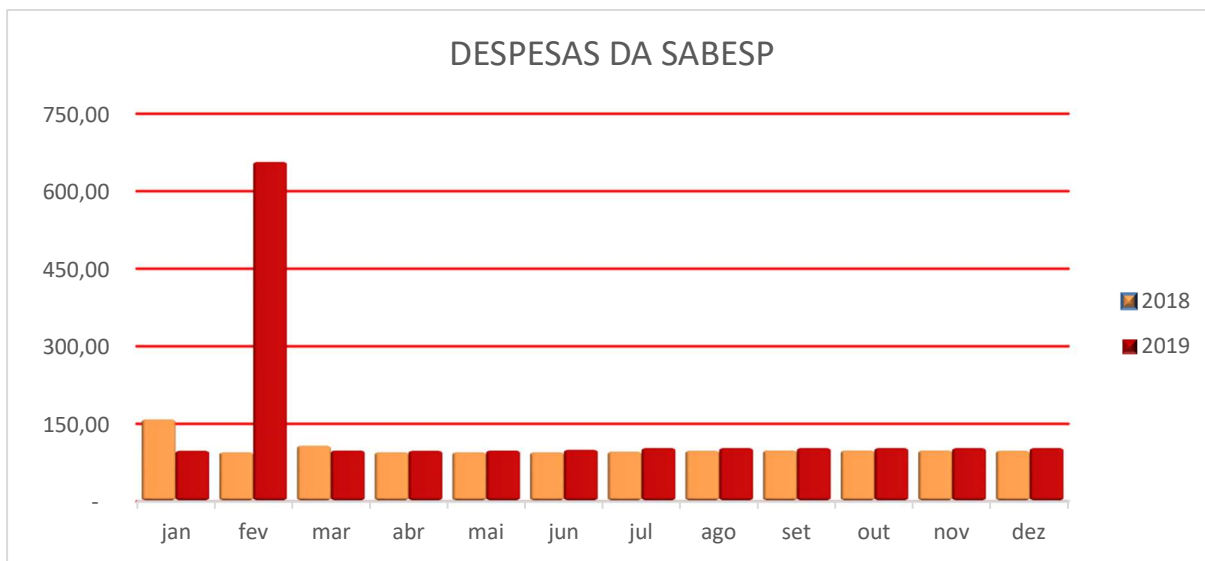
1.1 COMPRAS, LICITAÇÕES E CONTRATOS

O Controle Interno está inserido na rotina administrativa de análise de conformidade, sendo que ao longo do exercício participou da grande maioria dos processos de compras, pois priorizamos aqueles que são extraordinários e/ou eventuais em detrimento daqueles que são rotineiros, como por exemplo: água e luz, entretanto participamos de todos os processos referentes a licitações e contratos. Elaboramos abaixo um resumo dessas análises:

1.1.1 COMPRAS

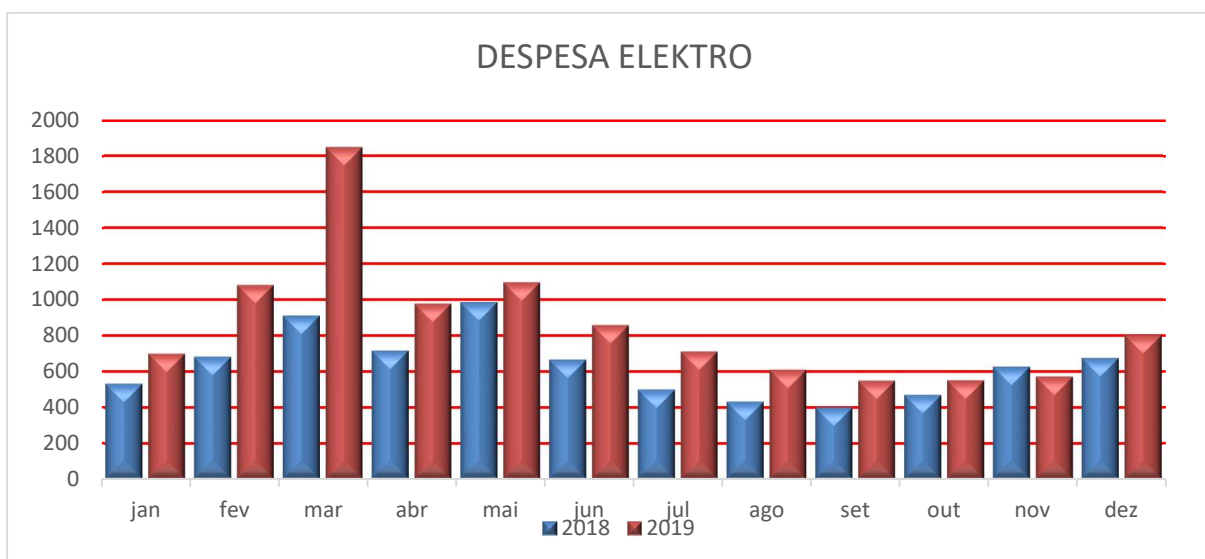
As despesas com compras eventuais foram verificadas e relatadas nos relatórios bimestrais. Fizemos uma análise das despesas ordinárias que são acompanhadas de perto e planilhadas pelo administrador do Instituto e elaboramos um resumo acompanhado de gráfico para uma melhor visualização, conforme segue abaixo:

DESPESAS COM ÁGUA - SABESP												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	161,00	97,48	110,19	97,48	97,48	97,48	98,57	100,40	100,90	100,90	100,90	100,40
2019	100,90	659,15	100,90	100,90	100,90	102,16	105,66	105,66	105,66	105,66	105,66	105,66



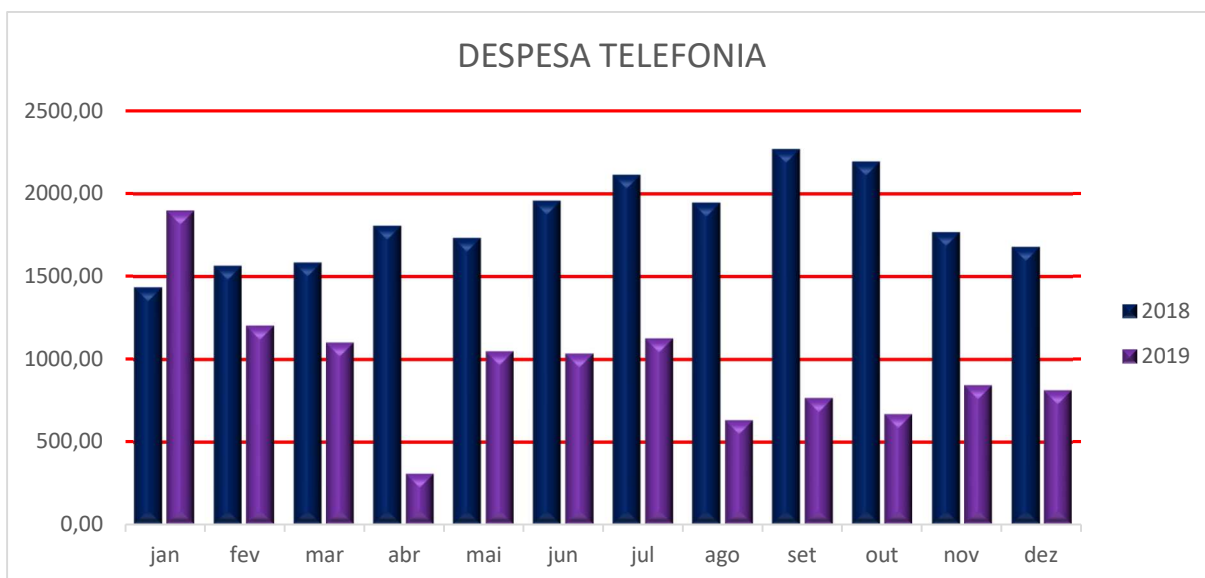
(Valor a maior em fev/2019 foi fruto de vazamento, conforme relatado no Proc. Adm. 008/19).

DESPESAS COM LUZ - ELEKTRO												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	527,87	679,16	907,13	713,02	982,06	662,85	496,93	428,90	397,29	466,05	622,71	672,14
2019	697,07	1078,42	1845,28	976,24	1093,37	855,6	709,32	606,73	546,00	548,59	570,05	799,47



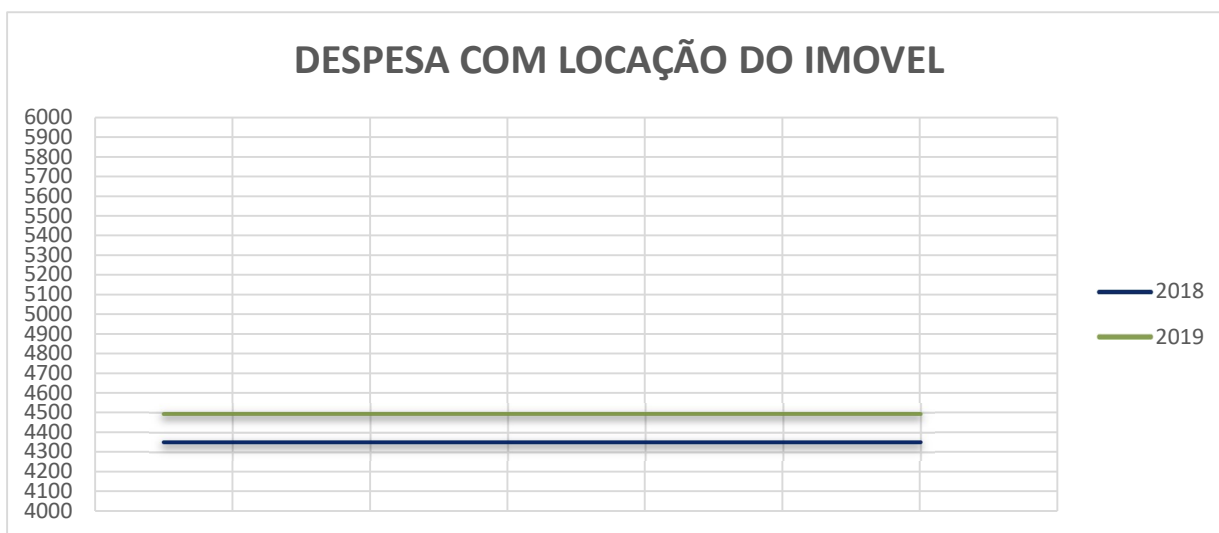
(O consumo costuma subir nos meses de verão).

DESPESAS COM TELEFONIA - VIVO												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	1433,00	1563,07	1581,51	1804,82	1731,87	1955,22	2112,72	1943,79	2267,39	2191,39	1766,13	1676,12
2019	1895,79	1201,21	1098,44	306,64	1046,52	1032,38	1123,87	628,89	763,27	666,83	841,03	809,28

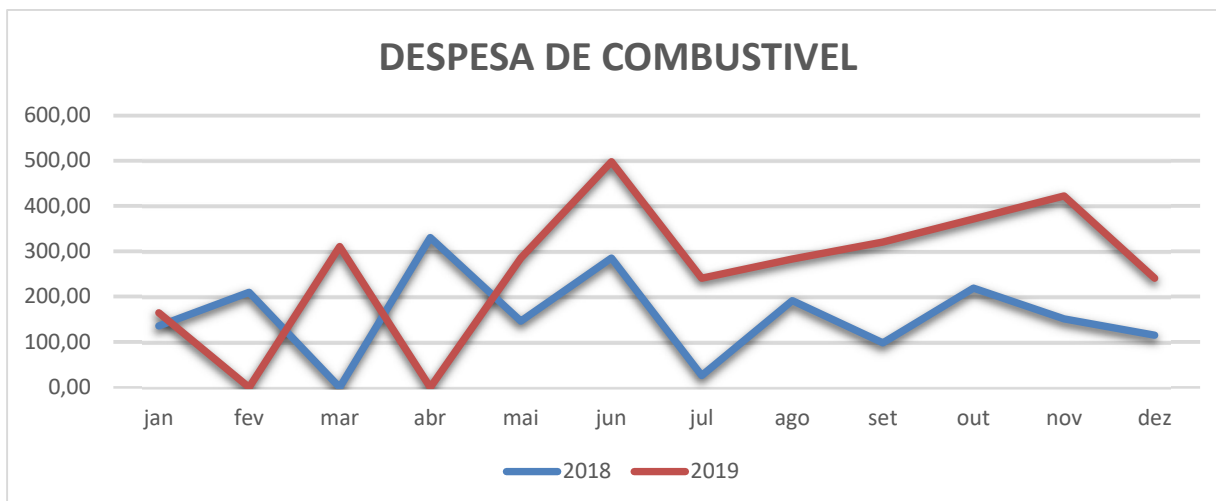


(Houve uma boa gestão dos contratos resultando em uma redução dos gastos).

DESPESAS COM ALUGUEL												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00	4350,00
2019	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70	4492,70

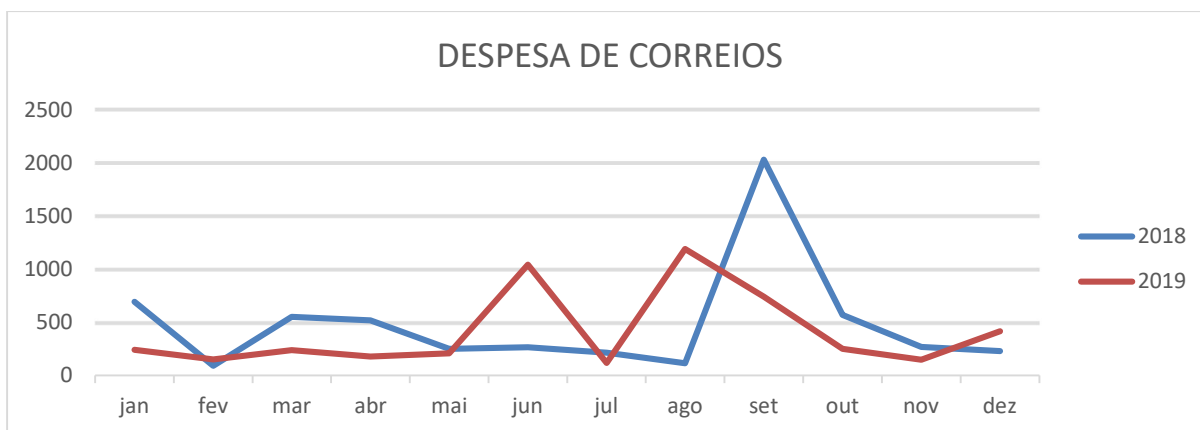


DESPESAS COM COMBUSTIVEL												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	134,89	209,59	0,00	330,30	146,00	284,65	25,40	191,16	97,58	218,50	150,53	114,55
2019	164,22	0,00	310,62	0,00	285,04	497,68	240,63	282,82	320,54	370,95	422,40	240,63



(O aumento do consumo a partir de mai/19 reflete a maior participação em cursos e reuniões de intercâmbio com outros Órgãos, como por exemplo: Apeprem/Abipem/INSS/TCESP/Bancos de Investimentos em geral).

DESPESAS COM CORREIOS												
ANO/MÊS	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	693,05	89,87	551,64	516,64	249,54	265,32	213,42	113,44	2032,71	570,07	266,47	228,98
2019	240,23	148,39	238,65	178,00	205,79	1043,39	117,87	1192,52	741,45	248,67	145,9	414,45



(Os valores a maior em jun/19 foram referentes a convocação de reavaliações médicas e ago/19 foram referentes ao recadastramento/19 realizado que reduziu em comparação ao exercício de 2018, tendo em vista a implantação de recadastramento online).

1.1.2 LICITAÇÕES

No exercício de 2019, houve sete processos licitatórios, sendo seis por modalidade pregão, um por modalidade convite e nenhum por modalidade concorrência, conforme quadro abaixo e sendo verificado nos respectivos processos e apontamentos nos relatórios bimestrais do Controle Interno.

Licitação nº	data da homologação	modalidade	objeto
01/19	15/02/2019	pregão	Link de acesso à internet
02/19	13/06/2019	pregão	Sistema de contabilidade
03/19	05/07/2019	pregão	Serviço de perícia médica para análise de aposentadoria especial
04/19	07/08/2019	convite	Serviço de consultoria financeira
05/19	17/10/2019	pregão	Serviço de software previdenciário
06/19	28/11/2019	pregão	Serviço de locação de computadores
07/19	05/12/2019	pregão	Contratação de empresa especializada em fornecer diariamente via correio eletrônico e website o boletim de publicações de interesse do BERTPREV

1.1.3 CONTRATOS

Os contratos celebrados e/ou renovados no exercício de 2019 seguiram os trâmites legais previstos e foram verificados, conforme relatórios dessa Equipe de Controle Interno e não houve excesso de aditamento contratual em 2019.

1.2 RECURSOS HUMANOS

No exercício de 2019 não houve alteração no quadro de pessoal, apenas permuta, sem prejuízo, entre um Técnico Contábil (BERTPREV) e um Operador de Sistemas(PMB) e a partir de jan/19 houve o afastamento por licença médica de uma das servidoras que ocupa o cargo de Procuradora e que perdura até o momento. O único cargo comissionado do Instituto é o da Presidência, que não recebe horas extras.

O Instituto encaminhou, por meio do sistema SisCAA, a movimentação de pessoal do exercício de 2019, conforme Proc.Adm. 050/20.

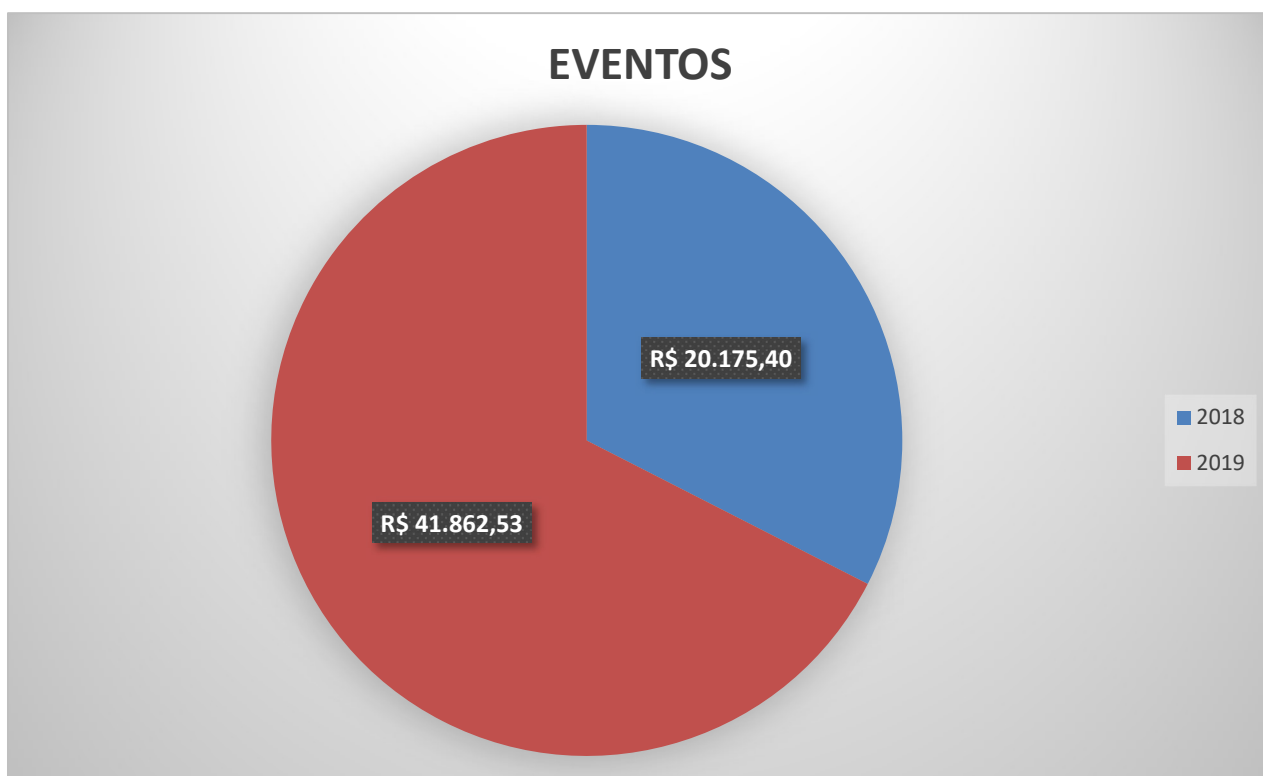
Com o intuito de reforçar o desempenho das atividades dos servidores, assim como dos conselheiros, no decorrer do ano foi promovida a participação em

vários cursos e congressos. Neste relatório corrigimos o valor total referente ao exercício de 2018 por erro em somatório apresentado no relatório anual, onde na ocasião faltou somar 2 eventos, conforme abaixo:

EVENTOS 2018	PROC ADM	VALOR inscrição	VALOR HTL+transp
Participação de Servidores do Instituto no 30º Seminário Nacional de Previdência Social - ABIPEM	061/18	993,00	1008,90
Contratação de Empresa para realização de Curso de Capacitação para os novos conselheiros	079/18	5.000,00	0
Participação de Servidores em Curso de Capacitação em Controle Interno	109/18	1.579,20	100,80
Participação de Servidores no 14º Congresso Estadual da APEPREM	110/18	1.170,00	460,00
Contratação de Empresa - Curso de Capacitação em Mercado Financeiro	161/18	5.520,00	0
Participação de Servidores no XII Encontro Temático Jurídico e Financeiro da APEPREM	189/18	1.750,00	1386
Participação de servidores no evento financeiro "Expert XP 2018"	226/18	-	1.207,50
TOTAL		16.012,20	4.163,20
TOTAL GERAL		R\$20.175,40	

EVENTOS 2019	PROC ADM	VALOR inscrição	VALOR HTL+transp
1º Congresso Brasileiro de Investimentos RPPS - Florianópolis/SC	062/19	1900,00	7384,48
15º Congresso Estadual da APEPREM -	096/19	2400,00	682,44
Curso Audesp fase IV - SP	126/19	1.000,00	-
52º Congresso Nacional da ABIPEM - Foz do Iguaçu/RS	118/19	2.850,00	8.338,75
Evento 2nd Macro Day e Reunião com Petros - RJ	162/19	-	2.993,86
XIII Encontro Temático Jurídico e Financeiro APEPREM - São Paulo/SP	168/19	3.990,00	2.016,00
7º Congresso Brasileiro de Conselheiros de RPPS - Belém/PA	193/19	2.565,00	5.742,00
TOTAL		14.705,00	27.157,53
TOTAL GERAL		R\$41.862,53	

(1- Valor total referente ao exercício de 2018 foi corrigido por erro em somatório apresentado no relatório anual, onde na ocasião faltou somar 2 eventos; 2- Embora a quantidade de eventos tenha sido a mesma, as despesas foram maiores por ampliação de servidores incluídos, bem como maior distância dos locais dos eventos necessitando contratação de transporte e hospedagem).



1.3 ALMOXARIFADO E BENS PATRIMONIAIS

Durante o exercício de 2019 foi realizado acompanhamentos mensais do almoxarifado com contagem física por amostragem, pela Comissão de Controle Interno, conforme relatórios bimestrais emitidos.

O inventário de bens de uso e consumo foi realizado no mês de abril e o inventário de bens patrimoniais foi realizado no mês de agosto e dezembro do exercício de 2019, conforme verificado nos proc. adm. 024/19 e 025/19.

No Ativo Imobilizado houve aquisição de Rack para servidor de dados - Proc. Adm. 259/2018, e celular - Proc. Adm. 111/2019.

O seguro do automóvel está vigente, da mesma forma o seguro do imóvel locado para sede do Instituto.

1.4 TRANSPARÊNCIA

O Instituto mantém uma página eletrônica, em atendimento a Lei nº 12.527/2011, de 18 de novembro de 2011, conhecida como Lei de Acesso à Informação (LAI), como mecanismo de acesso as suas informações institucionais de forma transparente, propiciando amplo acesso e divulgação de informações e dados de interesse público, a exemplo de procedimentos licitatórios, folha de pagamento e ações governamentais.

2. CONTROLE DA ÁREA CONTÁBIL E FINANCEIRA

2.1 EXECUÇÃO ORÇAMENTÁRIA

A LOA (Lei Orçamentária Anual) para o exercício de 2019 foi apresentada e aprovada pelo Conselho Administrativo na reunião do dia 16.08.2018 e normatizada pelo decreto nº 3088 de 02.01.2019, publicado no Boletim Oficial nº 871 e no decorrer do exercício sofreu algumas adequações devido inclusões de categorias econômicas no plano de contas (Tribunal de Contas do Estado de São Paulo) e também por necessidade de adequações orçamentárias:

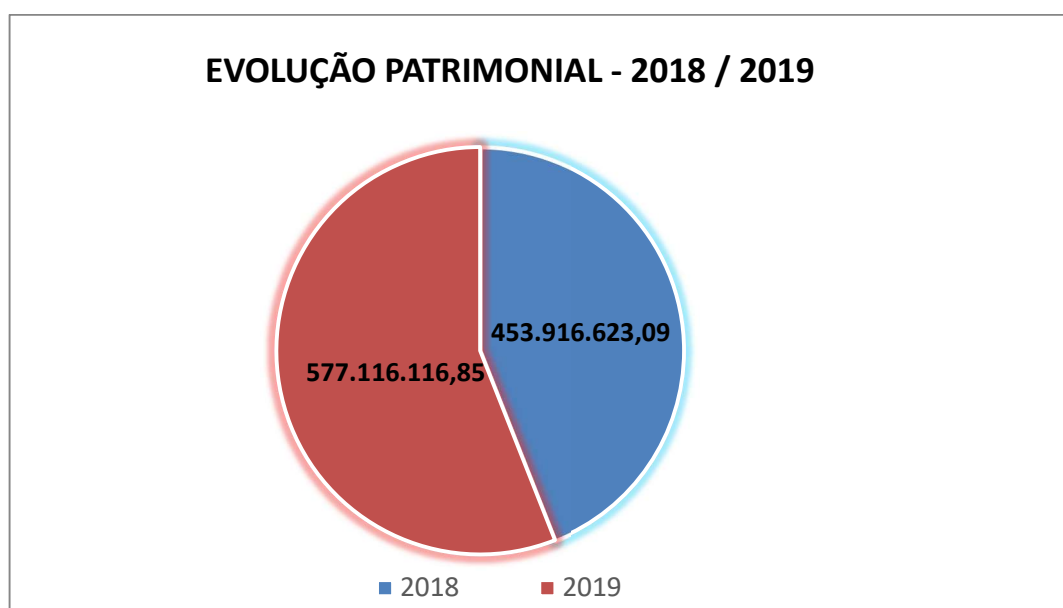
- Decreto nº: 3125 de 29.03 - crédito adicional;
- Decreto nº: 3142 de 02.05 inclusão de categorias econômicas para o exercício pelo Tribunal de Contas;
- Decreto nº: 3226 de 04.10 – crédito adicional, e
- Decreto nº: 3273 de 20.12 - crédito adicional.

2.2 **DEMONSTRAÇÕES CONTÁBEIS**

O Balanço Patrimonial do exercício foi apresentado e aprovado pelos Conselhos do Instituto: Administrativo e Fiscal, em reunião extraordinária conjunta, conforme Ata dia 21.05.2020, assim como suas notas explicativas e relatório da gestão administrativa do Instituto durante o ano de 2019, as demonstrações contábeis foram enviadas aos órgãos de controle externo, Tribunal de Contas do Estado (Audesp) e Secretaria da Previdência Social e já se encontram auditadas pelos respectivos órgãos.

2.3 **EVOLUÇÃO PATRIMONIAL**

Houve uma evolução patrimonial dos investimentos no decorrer do exercício em comparação ao exercício anterior, em 2018 encerramos com o patrimônio de R\$ 453.916.623,09 e o exercício de 2019 no patamar de R\$ 577.116.116,85 demonstrando uma elevação patrimonial aproximada de 27,15%.



Neste total patrimonial estão inclusos os valores disponíveis em c/c, exercício de 2018 R\$ 2.606,41 e no exercício de 2019 R\$ 20.306,96 destacamos abaixo os valores aplicados por segmento com exceção dos valores em c/c já citados:

- **Em 2018**

Renda Fixa: R\$ 329.652.632,25

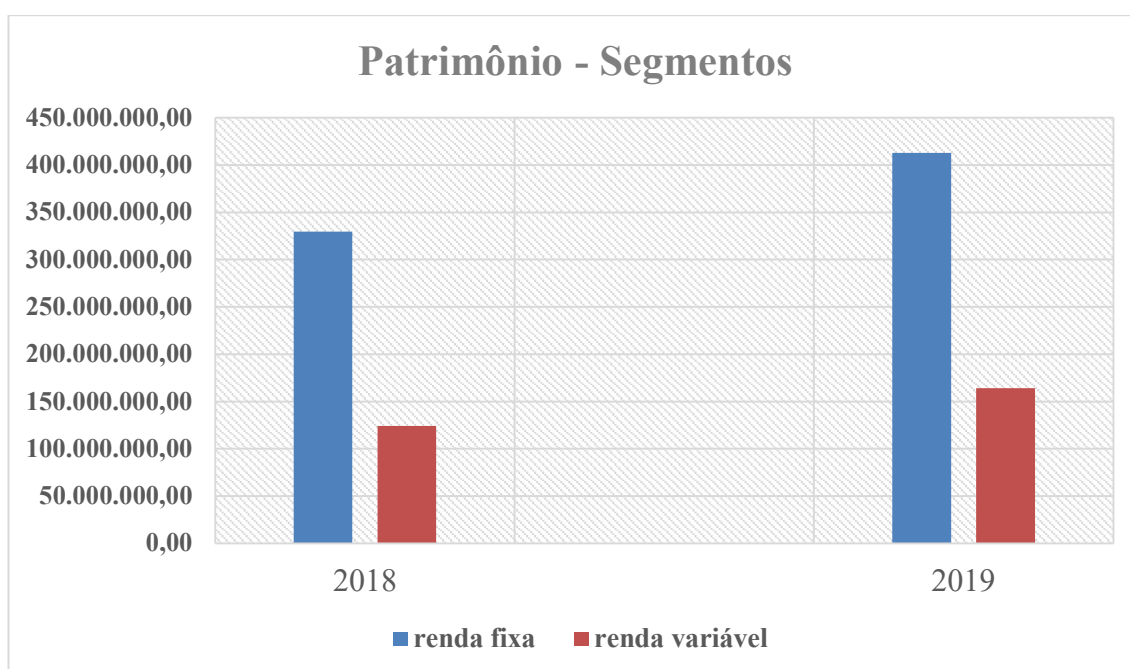
Renda Variável: R\$ 124.263.990,84

- **Em 2019**

Renda Fixa: R\$ 412.900.930,26

Renda Variável: R\$ 164.194.879,63

Demonstração gráfica dos segmentos dos exercícios 2018 e 2019:



A meta atuarial para os investimento (IPCA + 6% = 10,59%) foi cumprida e obtivemos o resultado de 21,87%, e pelo terceiro ano consecutivo o Instituto ficou acima da meta, conforme relatório financeiro de Dezembro/2019 confeccionado pela Consultoria Financeira e apresentado aos Conselhos em reunião extraordinária dia 21.05.2020.

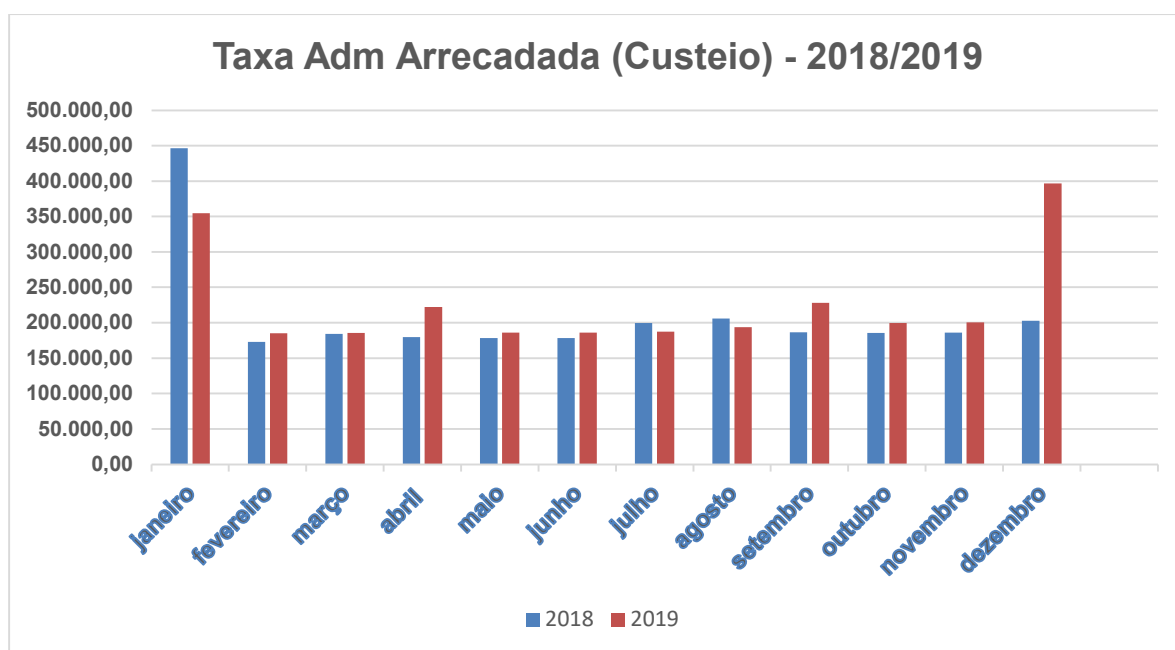
Destacamos que nesse item há uma divergência de valores no quesito total patrimonial com os valores considerados pela Consultoria Financeira, visto que

esta não considera os valores de investimentos da taxa administrativa, ou seja, os investimentos de custeio. Em todas as nossas informações e explicações contábeis levamos em consideração a totalidade dos recursos financeiros.

2.4 CUSTEIO/TAXA ADM – REPASSES DO EXERCÍCIO

O montante repassado ao Instituto à título de taxa administrativa (2,40%) sobre o repasse previdenciário patronal dos entes (PMB/Câmara/Bertprev) obteve um total de R\$ **2.724.800,30**, sendo:

- ✓ **R\$ 2.539.940,45** Prefeitura;
- ✓ **R\$ 70.207,75** Câmara;
- ✓ **R\$ 22.475,76** Bertprev;
- ✓ **R\$ 36.376,19** Recebimentos de Precatórios (PMB);
- ✓ **R\$ 1.800,15** Servidores Cedidos.



No gráfico acima podemos visualizar o comparativo do repasse para custeio entre os exercícios de 2018 e 2019, sendo 2018 o total de R\$ 2.506.891,98 e em 2019 o total de R\$ 2.724.800,30 conforme descrito acima.

A variação aumentativa no mês de Janeiro/2018 refere-se a valores repassados no exercício referente a competência anterior (Dez/2017) e no mês de dezembro/2019 a elevação deve-se a antecipação dos repasses da contribuição

previdenciária sobre o abono natalino dentro desse exercício, cujo vencimento seria janeiro 2020.

2.5 DESPESAS ADMINISTRATIVAS

Os valores da taxa administrativa têm por objetivo a subsistência do Instituto, tais valores custearam as despesas abaixo descritas:

- ✓ **R\$ 1.559.913,21** - Despesas com Pessoal (salários e benefícios como auxílio transporte e auxílio alimentação);
- ✓ **R\$ 486.435,11** – Encargos sociais (Pasep s/repasses do exercício).
- ✓ **R\$ 443.968,78** – Despesas com serviços (consultoria, locação de imóvel e software necessários para gestão do patrimônio);
- ✓ **R\$ 100.265,44** – Aporte Déficit do Bertprev para Previdência relativo ao exercício de 2018.
- ✓ **R\$ 12.939,74** – Despesas com material de consumo;
- ✓ **R\$ 3.148,45** - Despesas com equipamentos de ordem permanente;

Comparando os exercícios para uma verificação da evolução das Despesas Administrativas – 2018/2019

	2018	2019
DESPESAS COM PESSOAL	1.326.683,96	1.559.913,21
DESPESAS COM SERVIÇOS (PF/PJ)	386.074,10	443.968,78
ENCARGOS SOCIAIS	419.772,99	486.435,11
APORTE DÉFICIT	42.735,75	100.265,44
MATERIAL DE CONSUMO	12.620,11	12.939,74
MATERIAL PERMANENTE	15.190,00	3.148,45
TOTAL	2.203.076,91	2.606.670,73



2.6 IMPOSTOS E ENCARGOS SOCIAIS

No decorrer do exercício foram repassados impostos e encargos sociais à União e ao Município, como segue:

- ✓ R\$ 1.986.242,37 - Imposto de Renda repassados à PMB.
- ✓ R\$ 486.435,11 - Pasep sobre os repasses ao Ministério da Fazenda
- ✓ R\$ 128.405,22- Pasep sobre as receitas financeiras ao Ministério da Fazenda.
- ✓ R\$ 13.145,36 - Pis/Cofins/CSLL ao Ministério da Fazenda
- ✓ R\$ 5.068,38 – ISS repassados a PMB.

2.7 ADIANTAMENTO DE VERBAS

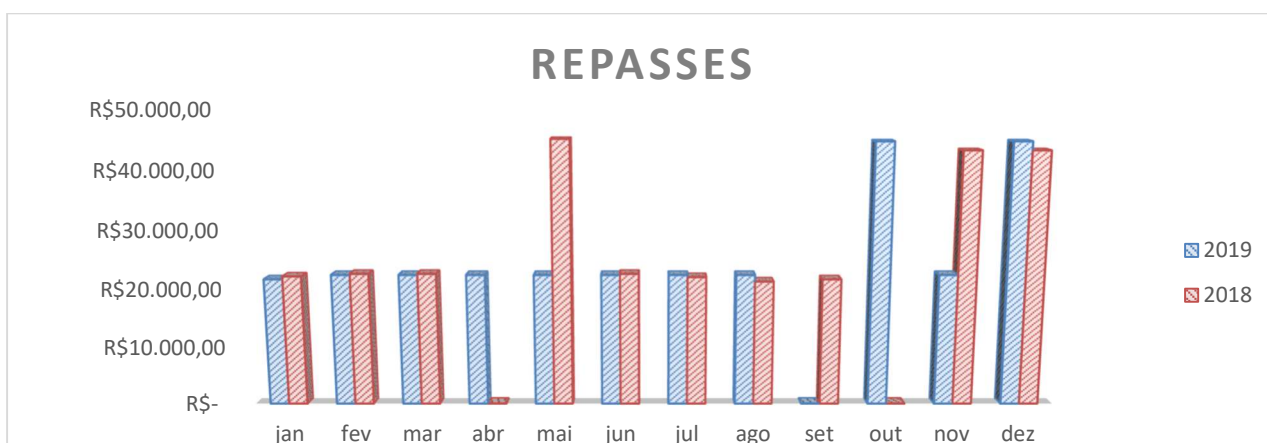
No exercício de 2019 foram abertos pelo Instituto 12 Processos Administrativos referentes a verba de adiantamento, sendo eles: 002/19, 068/19, 090/19, 123/19, 148/19, 178/19, 187/19, 194/19, 220/19, 225/19 e 244/19 estes processos abrangem tanto adiantamento para pequenas despesas do Instituto, como adiantamento para as viagens efetuadas com o objetivo de participação em eventos e cursos realizados no decorrer do exercício. Todos passaram por verificação e dado conformidade pelo Controle Interno e auditados pelo Tribunal de Contas.

3. CONTROLE DA ÁREA PREVIDENCIÁRIA

3.1 REPASSES PREVIDENCIÁRIOS

Os repasses da Prefeitura, Câmara Municipal e Bertprev, bem como os acordos da PMB e os servidores cedidos, relativos ao ano de 2019, foram efetivados em boa ordem.

Em relação aos repasses do **COMPREV** no decorrer do ano de 2019:



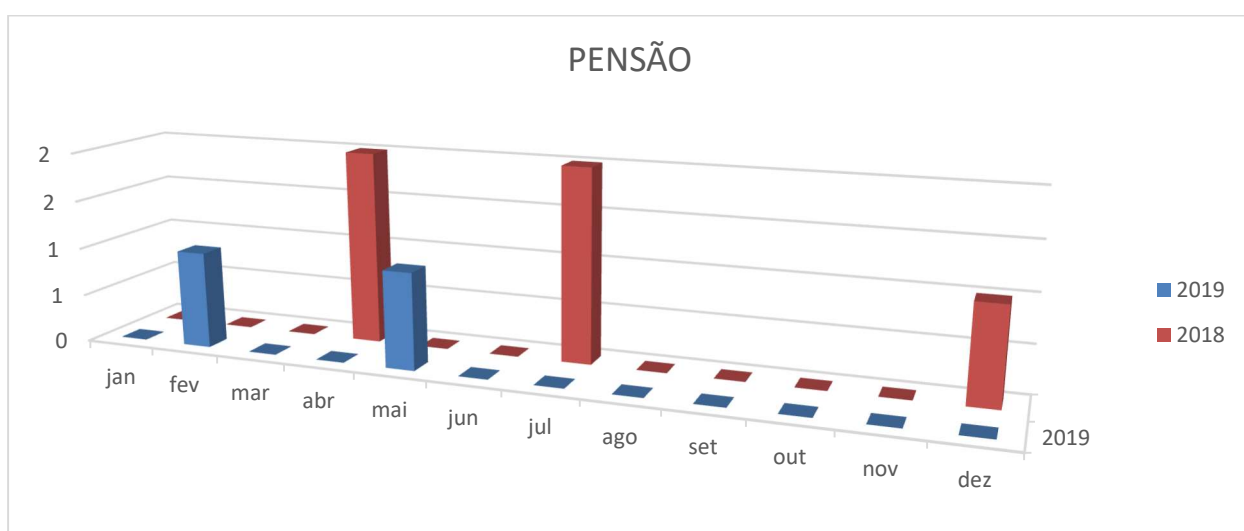
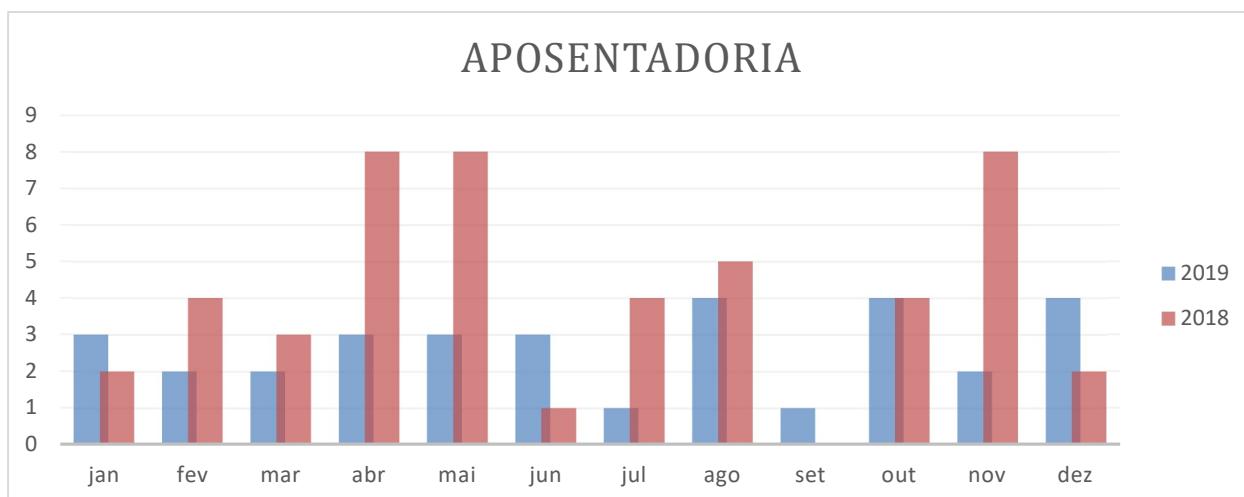
(os valores que aparecem zerados, foram repassado no mês seguinte).

Foram 45 processos homologados, dos quais 12, não tinham direito ao COMPREV e foram enviados 33 requerimentos.

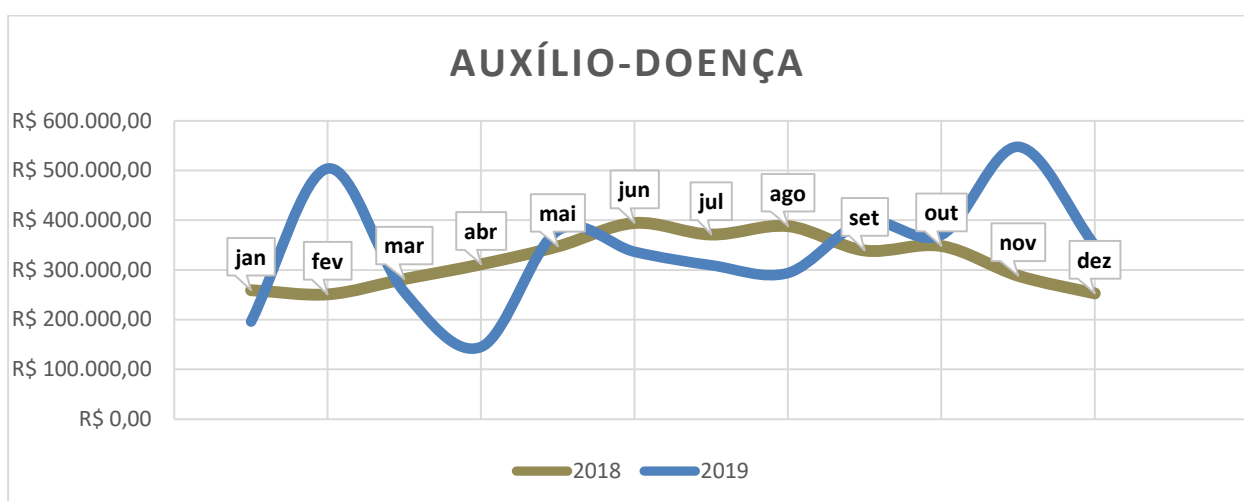
As homologações pelo Tribunal de Contas de aposentadorias e pensões no ano de 2019 foram realizadas conforme processo TC – 00011751.989.20-3 e publicada em 27/05/2020.

3.2 BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS

Todos os atos concessórios dos benefícios de Aposentadoria e Pensão, bem como revisão através Apostila Retificatória, foram encaminhados ao TCESP, por meio do SISCAA, conforme demonstrado em Proc. Adm. 050/20. No período do ano 2019, foram concedidos os benefícios abaixo:



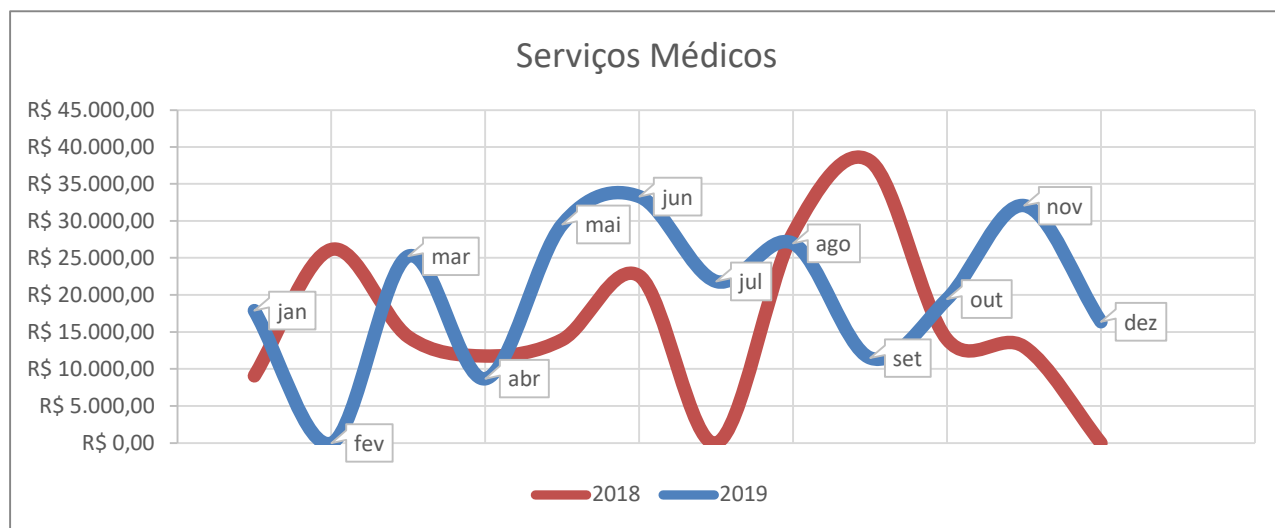
(os valores que aparecem zerados é porque não houve evento).



(valores descontados do repasse).

3.3 SERVIÇOS MÉDICOS

Serviços prestados de perícia médica nos benefícios de auxílio doença, Licença Maternidade, Avaliação Semestral, Junta Médica, Avaliação bienal de Aposentadoria por Invalidez e Avaliação de reconhecimento de Invalidez de dependente.



(os valores que aparecem zerados, foram repassado no mês seguinte).

3.4 CÁLCULO ATUARIAL

Foi realizada a avaliação atuarial com a base enviada em 31/10/2019 e apresentada em 21/05/2020. Houve alteração do déficit, conforme LC 153/20, publicada no Boletim Oficial nº. 927 em 25/01/2020, porém, não houve alteração nas alíquotas.

Houve o recadastramento dos ativos em 2019, assim, nossa base está mais atualizada.

4. **CONSIDERAÇÕES FINAIS**

As informações apresentadas neste Relatório são fruto do comprometimento e do empenho contínuo da Equipe de Controle Interno e do apoio e colaboração de nossos companheiros de trabalho.

Ao longo do ano procuramos oferecer sempre sugestões para melhor entendimento dos procedimentos a serem adotados e de modo geral, os trabalhos desenvolvidos apresentaram-se satisfatoriamente às demandas internas.

Contudo, algumas ações planejadas ainda ficaram por fazer, como a participação em cursos, a ampliação de participação nas reuniões do Comitê de investimento e conselhos, bem como o aprimoramento da legislação para a regulamentação das nossas atividades, pois não foram acatadas pela PMB as sugestões enviadas em minuta de PL.

O ano de 2019 foi atípico, marcado por muitas mudanças, tanto externa como a proposta da Reforma da Previdência, quanto interna, como a alteração da empresa prestadora de serviço de software previdenciário, que acarretou uma demanda maior que a esperada para os ajustes de informações na base de dados e consequentemente ocasionando um aumento do tempo de execução nas tarefas rotineiras.

Com a aprovação da EC 103/19, que promoveu a reforma da previdência, o Instituto passou a ser responsável apenas pelas aposentadorias e pensões, ficando por conta do Ente Patronal todos os benefícios de auxílio doença, acidente de trabalho e licença maternidade, e também houve alteração da alíquota dos servidores para 14% sobre a remuneração de contribuição que excede o teto do INSS a partir de dez/18 e a partir de abril de 2020 a contribuição de 14% sobre total da remuneração de contribuição para os servidores ativos.

No final de 2019 o TCE/SP julgou Prestação de Contas do Exercício de 2015 e tomou-se ciência da manifestação da Assessoria Técnica Jurídica indicando a aprovação das contas com a ressalva da ausência de legislação dispondo sobre a representatividade do Comitê de Investimentos por entender em desacordo com a Portaria 519/2011. O Instituto recorreu dessa ressalva em 04/03/2020, sendo que já consta nos autos o parecer favorável ao recurso pelo titular da SDG/TCE, Sr. Sergio Ciquera Rossi e aguardando o julgamento final, conforme Proc. Adm. nº 034/2016.

Em 2019 o Instituto recebeu o troféu de 1º lugar na Categoria 2 do “PRÊMIO DESTAQUE BRASIL DE RESPONSABILIDADE PREVIDENCIÁRIA” – ABIPEM (Associação Brasileira de Instituições de Previdência Estaduais e Municipais), que teve como objetivo: fomentar, identificar, reconhecer e divulgar instituições que sirvam de referência no âmbito da gestão previdenciária.

Continuaremos trabalhando no sentido do aprimoramento das nossas atividades, buscando aprimorar as ações do Instituto com o intuito de reforçar a importância da transparência, a padronização dos procedimentos internos e auxiliar sempre que necessário.