

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2017—Aos 27 de dezembro do ano de dois mil e dezessete, às dez horas, na sede do Bertprev, localizado à Rua Rafael Costábile, 596, centro - Bertioga-SP, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos deste Instituto - Srs. **Marco Aurélio de Thommazo – Presidente do Comitê, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Clayton Faria Schmidt e Jean Mamede de Oliveira.** 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 22/12/2017, mercedores de destaque:

| COPOM | Referência | Exercício | Situação | Anterior | Atual |
|------------------|---------------------|-----------|----------|----------|-------|
| Taxa Selic Atual | 25/10/17 a 06/12/17 | 2017 | Redução | 7,50% | 7,00% |

Fonte: Banco Central do Brasil

| Índice | Referência | Exercício | Situação | Previsão | |
|---|---------------------|-----------|----------|----------|----------|
| | | | | Anterior | Atual |
| Meta Taxa Selic (final de período) | Mediana agregada | 2017 | - | - | - |
| PIB | Mediana agregada | 2017 | Elevação | 0,96 % | 0,98 % |
| Cotação do Dólar (final do período) | Mediana agregada | 2017 | Elevação | R\$ 3,29 | R\$ 3,30 |
| Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período) | Mediana Top 5 | 2017 | - | - | - |
| IPCA (Expectativas - Curto Prazo) | Mediana Top 5 | 2017 | Redução | 2,80 % | 2,79 % |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 9324d.u. - 2055) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 5,6156 | 5,5513 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2046) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 5,5986 | 5,5319 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2036) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 5,5534 | 5,4806 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2026) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 5,4165 | 5,3255 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2021) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 5,0576 | 4,9413 |
| Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2018) | Anbima – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 3,4423 | 3,3492 |
| Ibovespa | BM&F – 26/12/2017 | 2017 | Redução | 72.680 p | 75.707 p |
| Risco Brasil (JP Morgan) | 26/12/2017 | 2017 | Elevação | 234 | 237 |
| Posição dos Investimentos | Out/17 - Nov/17 | 2017 | em Mil | 382.644 | 378.358 |

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

O cenário econômico se mantém estável quanto à política monetária; a ETTJ apresenta redução em todos os vértices; câmbio se mantém estável; o risco país sofre discreta elevação; O IBOVESPA apresentou forte elevação para 75.707p.; os analistas de mercado sinalizam a redução do IPCA tanto para 2017 quanto para 2018. A posição dos investimentos em 27/12/2017 é de R\$ 382M. Em anexo a esta ata o calendário de reuniões do Comitê para o ano 2018.



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

Foram emitidas as seguintes APRs:

| APR | Data da Operação | Movimento R\$ | Aplicação/Resgate | Produto |
|----------|------------------|---------------|-------------------|---|
| 178/2017 | 27/12/2017 | 10.000,00 | Resgate | SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 1) |
| 179/2017 | 20/12/2017 | 32.000,00 | Aplicação | SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 3) |
| 180/2017 | 26/12/2017 | 77.000,00 | Aplicação | SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 3) |
| 181/2017 | 28/12/2017 | 221.000,00 | Resgate | SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 3) |

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:00 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Marco Aurélio de Thommazo

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Clayton Faria Schmidt

Jean Mamede de Oliveira

Relatório de Investimentos Acompanhamento Semanal

27/12/2017

5

| CNPJ | Fundo | Patrimônio | % PL | Limite % PL 3922/10 | Saldo Dez/16 Evolução PL | R\$ 313.933.565,66 | | Margem | Enquadramento |
|--------------------|--|-----------------------|---------------|------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|----------------|--------------------------------|
| | | | | | | R\$ 68.080.369,41 | Saldo Anterior | | |
| | | | | | Limite Inferior (%) | Estratégia Alvo | Limite Superior (%) | | |
| | TOTAL PATRIMÔNIO | 382.013.935,07 | 100,0% | | | | | | |
| XXX XXX XXX | (*) CONTA TRANSITÓRIA | | | | | | | | |
| | Títulos Públicos | 130.553.312,85 | 34,18% | 100,00% | 20,00% | 42,00% | 70,00% | 7,82% | Artigo 7, Inciso I, Alínea A |
| CP 0184 | CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs) | 130.553.312,85 | 34,18% | | | | | | |
| | Fundos que contêm somente títulos públicos | 65.840.901,12 | 17,24% | 100,00% | 10,00% | 26,00% | 60,00% | 8,76% | Artigo 7, Inciso I, Alínea B |
| 22.791.074/0001-26 | CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF | 16.599.765,00 | 4,345% | | | | | | |
| 19.769.046/0001-06 | CAIXA BRASIL 2030 II TP | 13.350.405,20 | 3,495% | | | | | | |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP | 57.590,23 | 0,015% | | | | | | |
| 19.523.305/0001-06 | BB PREV RF TP VII FI | 25.688.043,03 | 6,724% | | | | | | |
| 13.455.197/0001-03 | SANTANDER IRFM TP FI RF | 207.900,87 | 0,054% | | | | | | |
| 14.504.578/0001-90 | SANTANDER FIC FI IMA-B INST TP RF LP | 9.937.196,79 | 2,601% | | | | | | |
| | Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - aberto | 76.561.207,08 | 20,04% | 80,00% | 0,00% | 0,00% | 40,00% | 0,00% | Artigo 7, Inciso III, Alínea A |
| | Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - fechado | 15.680.446,99 | 4,105% | 30,00% | 5,00% | 8,00% | 30,00% | -12,04% | Artigo 7, Inciso IV, Alínea A |
| 03.069.104/0001-40 | SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI | 13.997.893,70 | 3,664% | | | | | | |
| 15.486.093/0001-83 | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI | 9.286.855,95 | 2,431% | | | | | | |
| 19.303.795/0001-35 | BB PREV TP IPCA III | 67.053,65 | 0,018% | | | | | | |
| 07.539.298/0001-51 | BTG PACTUAL TESOURO IPCA CURTO FI RENDA FIXA | 3.952.755,00 | 1,035% | | | | | | |
| 18.598.256/0001-08 | FIC CAIXA BRASIL 2018 I TP RF | 2.357.177,34 | 0,617% | | | | | | |
| 21.838.150/0001-49 | ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI | 30.161.101,59 | 7,895% | | | | | | |
| 25.306.703/0001-73 | ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI - II | | | | | | | | |
| | Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - aberto | 3.074.613,11 | 0,805% | 15,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 0,00% | Artigo 7, Inciso VI |
| | Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - fechado | 3.074.613,11 | 0,805% | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 0,00% | Artigo 7, Inciso VII, Alínea A |
| 14.091.645/0001-91 | FI Renda Fixa Crédito Privado | 3.074.613,11 | 0,805% | | | | | | Artigo 7, Inciso VII, Alínea B |
| | Fundos de Renda Variável | 30.678.817,30 | 8,03% | 30,00% | 0,00% | 6,00% | 10,00% | -2,03% | Artigo 8, Inciso I |
| 08.817.414/0001-10 | ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI | 30.678.817,30 | 8,031% | | | | | | |
| | Fundos de Renda Variável | 61.596.536,42 | 16,12% | 15,00% | 5,00% | 14,00% | 15,00% | -2,12% | Artigo 8, Inciso III |
| 11.392.165/0001-72 | QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES | 9.989.165,51 | 2,615% | | | | | | |
| 07.279.657/0001-89 | QUEST AÇÕES FIC FIA | 6.654.014,11 | 1,742% | | | | | | |
| 11.977.794/0001-64 | BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA | 26.116.063,13 | 6,836% | | | | | | |
| 09.290.813/0001-38 | BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA | 5.454.286,42 | 1,428% | | | | | | |
| 09.087.523/0001-91 | WESTERN VALUATION FI EM AÇÕES | 6.136.857,13 | 1,606% | | | | | | |
| 11.108.013/0001-03 | BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES | 4.817.980,18 | 1,261% | | | | | | |
| 15.154.441/0001-15 | CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC FIA | 2.428.169,94 | 0,636% | | | | | | |
| | Fundos de Investimentos Multimercado | 14.766.470,05 | 3,87% | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 0,00% | Artigo 8, Inciso IV |
| | FI em Participações - Fechado | 14.766.470,05 | 3,865% | 5,00% | 0,00% | 3,00% | 5,00% | -0,87% | Artigo 8, Inciso V |
| 16.437.148/0001-28 | KINEA PRIVATE EQUITY II FIC FIP | | | | | | | | |
| | Fundo Imobiliário - Cotas negociadas em bolsa | - | 0,00% | 5,00% | 0,00% | 0,00% | 3,00% | 0,00% | Artigo 8, Inciso VI |
| | | | 0,000% | | | | | | |

Marcelo Augusto Trindade Costa
Téc. de Contabilidade - MATRÍCULA
Res. 016 CAC 18/2010-0-A

Agenda de Reuniões do Comitê de Investimentos para 2018

| Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun |
|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 03 | 08 | 07 | 04 | 02 | 06 |
| 10 | 15 | 14 | 11 | 09 | 13 |
| 17 | 21 | 22 | 18 | 17 | 21 |
| 24 | 28 | 28 | 25 | 23 | 27 |
| 31 | | | | 30 | |
| | | | | | |
| Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez |
| 04 | 02 | 05 | 03 | 01 | 05 |
| 11 | 08 | 12 | 10 | 07 | 13 |
| 18 | 15 | 20 | 17 | 14 | 19 |
| 25 | 22 | 26 | 24 | 21 | 26 |
| | 29 | | | 28 | |
| | | | | | |