

Comitê de Investimentos

Ata nº 07/2018—Aos 15 de fevereiro do ano de dois mil e dezoito, 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, Wilson Paschoal dos Santos, Jean Mamede de Oliveira, Clayton Faria Schmidt e José Daniel Rodrigues.** 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 09/02/2018, mercedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/17 a 07/02/17	2018	Redução	7,00%	6,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2018	Estável	6,75 %	6,75 %
PIB	Mediana agregada	2018	Estável	2,70 %	2,70 %
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2018	Estável	R\$ 3,30	R\$ 3,30
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2018	Elevação	6,50%	6,75%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2018	Redução	3,90 %	3,80 %
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 9198 d.u. - 2055)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	5,2791	5,2946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2048)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	5,257	5,2744
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2038)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	5,1952	5,2177
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2028)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	5,0095	5,0474
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2023)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	4,6383	4,7064
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2020)	Anbima – 14/02/2018	2018	Elevação	3,5487	3,6477
Ibovespa	BM&F – 14/02/2018	2018	Elevação	82.766 p	83.543 p
Risco Brasil (JP Morgan)	14/02/2018	2018	Elevação	226	249
Posição dos Investimentos	Nov/17 – Dez/17	2017	em Mil	378.358	385.467

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

O cenário econômico se mantém estável quanto à política monetária; ETTJ apresenta elevação em todos os vértices; o risco país sofre considerável elevação; O IBOVESPA apresenta valorização para 83.543; o cenário político continua instável devido às incertezas quanto a aprovação das reformas e as próximas eleições. O relatório da posição dos investimentos nesta data apresenta o patrimônio de R\$ 400.304M.





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

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

Wilson Paschoal dos Santos

Clayton Faria Schmidt

Jean Mamede de Oliveira

José Daniel Rodrigues



Relatório de Semanal

15/02/2018

CNPJ	Fundos	Patrimônio	% PL	Limite % PL 4.604/17	Saldo Day/17	Evolução PL	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		Margem	Enquadramento
							Lim. Inferior (%)	Lim. Superior (%)		
	TOTAL PATRIMÔNIO	400.304.792,51	100%							
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA		0,00%							
	Títulos Públicos Federais	133.949.638,17	33,46%		20,00%		36,00%	45,00%	2,54%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PROPR.A (NTNS)	133.949.638,17	33,46%							
	Fundos 100% Títulos Públicos	67.630.758,94	16,89%		10,00%		18,00%	60,00%	1,11%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	17.153.409,00	4,285%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 ITP	13.905.082,40	3,474%							
11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	58.451,98	0,015%	100,00%						
14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INST TIT PUB RF LP	10.265.806,54	2,564%							
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	26.036.121,17	6,504%							
13.455.197/0001-03	SANTANDER IREM TP FI RF	211.887,85	0,053%							
	Fundo de Índice (ETF) 100% Títulos Públicos		0,00%		0,00%		0,00%	10,00%	0,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea C
	Operações Compromissadas		0,00%	5,00%	0,00%		0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso II
	Fundos Renda Fixa (Suícho Ref. não Atrrelado a taxa de juros de 1 dia)		0,00%		0,00%		0,00%	60,00%	0,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea A
	Fundo de Índice (ETF) Renda Fixa (Suícho Ref. não Atrrelado taxa de juros de 1 dia)		0,00%	60,00%	0,00%		0,00%	60,00%	0,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea B
	Fundos Renfornecidos Renda Fixa	75.947.814,34	18,97%		5,00%		15,00%	40,00%	-3,57%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
03.069.104/0001-40	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI	15.009.208,82	3,749%							
15.486.094/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PUBLICOS IPCA FI	14.354.280,31	3,586%							
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.421.289,75	2,354%							
07.539.298/0001-51	BTG PACTUAL TESOURO IPCA CURTO FI RENDA FIXA	67.966,10	0,017%	40,00%						
18.598.256/0001-08	FIC CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	4.009.032,00	1,001%							
21.838.150/0001-49	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	2.398.013,10	0,599%							
25.306.703.0001-73	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II RF FIC DE FI	30.688.024,26	7,666%							
	Fundo de Índice (ETF) Ref. Renda Fixa		0,00%		0,00%		0,00%	10,00%	0,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea B
	Letra Imobiliária Garantida (LIG)		0,00%	20,00%	0,00%		0,00%	10,00%	0,00%	Artigo 7, inciso V, Alínea B
	CDB		0,00%		0,00%		0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 7, inciso V, Alínea A
	Poupança		0,00%	15,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%	Artigo 7, inciso V, Alínea B
	Fundos de Invest. em Direitos Creditórios - Cota Sênior		0,00%		0,00%		0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VI, Alínea A
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.061.211,19	0,76%		0,00%		0,00%	0,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VI, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREV RF CRED PRIV IPCA III	3.061.211,19	0,765%		0,00%		1,00%	5,00%	0,24%	Artigo 7, inciso VI, Alínea B
	Fundo de Debentures		0,00%	5,00%	0,00%		0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VI, Alínea C
08.814/0001-10	FI ref a índice de RV Divulgado pela B3 - Comp por no Min 50 Ações	35.895.726,10	8,97%		0,00%		8,00%	10,00%	-0,97%	Artigo 8, inciso I, Alínea A
	ITAU FOF RFI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	35.895.726,10	8,967%	30,00%			0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea B
	FI (ETF) - índice de RV Divulgado pela B3 - Comp por no Min 50 Ações		0,00%		0,00%		18,00%	20,00%	0,32%	Artigo 8, inciso I, Alínea C
	Fundos de Investimentos em Ações	70.778.056,02	17,68%		0,00%		0,00%	0,00%	0,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	12.006.688,63	2,999%							
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	8.673.068,78	2,167%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	29.317.140,92	7,324%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.659.807,25	1,414%	20,00%						
09.087.523/0001-91	WA MASTER VALUATION FIA	6.460.562,56	1,614%							
11.108.013/0001-03	BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA AÇÕES	6.069.302,91	1,516%							
15.154.444/0001-35	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.591.484,97	0,647%							
	Fundo de Índice (ETF)		0,00%		0,00%		0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea B
	Fundos de Investimentos Multimercado		0,00%	10,00%	0,00%		0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea C
	FI em Participações - FIP	13.041.587,75	3,26%		0,00%		3,00%	5,00%	-0,26%	Artigo 8, inciso III, Alínea A
16.437.148/0001-28	KINEA PRIVATE EQUITY II FIC FIP	13.041.587,75	3,258%	5,00%			0,00%	3,00%	0,00%	Artigo 8, inciso VI
	Fundo de Investimentos Imobiliário		0,00%	5,00%	0,00%		0,00%	3,00%	0,00%	

(Handwritten signatures and initials)

Alexandra Hoje Herrera
Presidente BERKTPREV