

Comitê de Investimentos

1

Ata nº 09/2018—Aos 28 de fevereiro do ano de dois mil e dezoito, às dez horas, na sede do Bertprev, localizado à Rua Rafael Costabile, 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 23/02/2018, 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	Elevação	2,80 %	2,89 %
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	Estável	6,75%	6,75%
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2018	Estável	3,73 %	3,73 %
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 9198 d.u. - 2055)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	5,2232	5,1799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2048)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	5,2037	5,16
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2038)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	5,1487	5,1039
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2028)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	4,9839	4,9358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2023)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	4,65	4,5918
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2020)	Anbima – 27/02/2018	2018	Redução	3,5255	3,4079
Ibovespa	BM&F – 27/02/2018	2018	Elevação	85.804 p	86.935 p
Risco Brasil (JP Morgan)	27/02/2018	2018	Redução	235	229
Posição dos Investimentos	Dez/17 – Jan/18	2018	em Mil	385.467	406.017

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

O cenário econômico continua estável quanto à política monetária; ETTJ apresenta redução em todos os vértices; o risco país sofre considerável redução; O IBOVESPA apresenta valorização para 86.935; O relatório semanal dos investimentos apresenta o patrimônio de R\$ 412.441M. O Comitê deliberou pelo credenciamento da instituição BNY MELLON, processo 201/16.



*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
033/2018	15/02/2018	170.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 1)
034/2018	22/02/2018	90.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 1)
035/2018	27/02/2018	98.000,00	Resgate	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 1)
036/2018	22/02/2018	43.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI (CONTA 3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:30 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

27/02/2018

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% Pl	Limite % Pl 4504/17	Saldo Neg/17 Evolução Pl	RS 385.467.812,33 RS 26.973.581,71	Lim. Superior (%)	Margem	32,38% 7,00%
TOTAL PATRIMÔNIO		412.441.194,04	100%		Em. Inferior (%)	Estratégia Ativo	Lim. Superior (%)	Margem	Emparelhamento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA		0,000%						
CP 0184	Títulos Públicos Federais CARTERA PROPRIA (NTNS)	137.686.743,85	33,38%		20,00%	36,00%	45,00%	2,62%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	74.498.223,53	18,06%		10,00%	18,00%	60,00%	-0,06%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	16.878.381,00	4,092%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	13.748.084,40	3,333%						
11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	58.858,39	0,014%						100,00%
14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INST TIT PUB RF LP	10.382.045,33	2,517%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	26.185.384,47	6,349%						
13.455.197/0001-03	SANTANDER IREMI TP FI RF	213.542,39	0,052%						
10.577.519/0001-90	CAIXA FI BRASIL IREMI 1+ RF LP	7.031.927,54	1,705%						
	Operações Compromissadas		0,00%		0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea C
	Fundos Renda Fixa (Sufixo Ref. não Atrilado a taxa de juros de 1 dia)		0,00%	5,00%	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso II
	Fundo de Índice (ETI) Renda Fixa (Sufixo Ref. não Atrilado taxa de juros de 1 dia)		0,00%	60,00%	0,00%	0,00%	60,00%	0,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea A
	Fundos Rentados Renda Fixa	70.386.741,44	17,07%		5,00%	15,00%	40,00%	-2,07%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
03.069.104/0001-40	SANTANDER FIC FI CORPORATE REF DI	4.143.529,26	1,005%						
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	14.468.388,87	3,508%						
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.455.435,58	2,293%						
07.539.298/0001-51	BTG PACTUAL TESOURO IPCA CURTO FI RENDA FIXA	68.520,72	0,017%						40,00%
18.598.256/0001-08	FIC CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	3.914.457,00	0,949%						
21.838.150/0001-49	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II RF FIC DE FI	2.414.930,42	0,586%						
25.306.703/0001-73	ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA II RF FIC DE FI	30.904.604,86	7,493%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.016.874,74	1,216%						
	Fundo de Índice (ETI) 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 IV, Alínea B
	CDR		0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VI, Alínea A
	Poupança		0,00%		0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VI, Alínea B
	Fundos de Invest. em Direitos Creditórios - Cota Senior		0,00%		0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea A
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.146.860,10	0,76%		0,00%	1,00%	5,00%	0,24%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
	BB PREV RF CIED PRIV IPCA III	3.146.860,10	0,763%						
	Fundo de Desdobras		0,00%		0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea C
08.817.414/0001-10	ITAU FOF 89 AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	38.525.718,23	9,341%		0,00%	8,00%	10,00%	-1,34%	Artigo 8, inciso I, Alínea A
	FI (ETI) - Índice de RV Divulgado pela B3 - Comp por no Min 50 Ações		0,00%		0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea B
	Fundos de Investimentos em Ações	75.155.319,14	18,22%		0,00%	18,00%	20,00%	-0,22%	Artigo 8, inciso I, Alínea C
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	12.552.266,54	3,043%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	9.235.693,66	2,239%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	31.666.094,14	7,685%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.979.839,49	1,450%						20,00%
09.087.523/0001-91	WA MASTER VALUATION FIA	6.837.598,66	1,658%						
11.108.013/0001-03	BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	6.127.012,36	1,496%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.681.814,30	0,650%						
	Fundo de Índice (ETI)		0,00%		0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea E
	Fundo de Investimentos Multirencado		0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	5,00%	0,00%	Artigo 8, inciso II
	FI em Participações - FIP	13.041.587,75	3,16%		0,00%	3,00%	5,00%	-0,16%	Artigo 8, inciso III, Alínea A
16.437.148/0001-28	KINETA PRIVATE EQUITY FIC FIP	13.041.587,75	3,162%		0,00%	0,00%	3,00%	0,00%	Artigo 8, inciso III, Alínea B
	Fundo de Investimentos Imobiliário		0,00%		0,00%	0,00%	3,00%	0,00%	Artigo 8, inciso VI

Alexandre de Menezes
 Presidente
 BERTPREV