

Comitê de Investimentos

Ata nº 15/2020—aos oito dias do mês de abril 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, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do Bertprev 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 03/04/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/02/2020 a 18/03/20	2020	Redução	4,25%	3,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	3,50	3,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-0,48	-1,18
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,50	4,50
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	3,13	3,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,37	2,31
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8728	5,1032
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8255	5,0878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,6444	4,9094
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,1111	4,2683
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	3,2739	3,3441
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –07/04/2020	2020	Redução	2,1338	1,8468
Ibovespa	07/04/2020	2020	Elevação	73.019	76.358
Risco Brasil (JP Morgan)	06/04/2020	2020	Elevação	393	437
Posição dos Investimentos	Dez/19–jan/20	2019	em Mil	575.862	582.196

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 acentuada elevação; o IBOVESPA tem elevação para 76.358 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 03/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 501.676M. Os administradores dos fundos de ações têm enviado a posição da carteira aberta inclusive a posição dos fundos mãe conforme solicitado. Foi concluída a ordem de serviço que oficialize a continuidade das reuniões de forma remota, em consonância com o Decreto Municipal nº 3319/2020 e que contemple a interferência nas tarefas administrativas, como por exemplo, os processos de credenciamento das instituições financeiras e respectivos fundos de Investimentos, conforme informou o Presidente do Bertprev. Solicitamos à CAF para efeito de credenciamento o envio dos processos do Banco Santander e respectivos fundos de investimentos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia junto ao mercado



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

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 12:23 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

2

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



Relatório Semanal de Investimentos

07 de abril de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 27/03/2020	Posição 03/04/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 -R\$ 74.859.032,59	27,37% -12,98%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	515.532.423,30	501.676.588,25	-2,69%	100,0%	100,0%	Nível II			
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA									
	Títulos Públicos Federal	158.680.257,16	154.883.744,04	-2,39%	30,87%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.680.257,16	154.883.744,04	-2,39%	30,87%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	105.583.090,02	105.643.375,25	0,06%	21,06%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	18.932.927,00	19.032.156,00	0,52%	3,794%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	15.814.551,60	15.504.116,00	-1,96%	3,090%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	15.847.604,96	15.963.058,59	0,73%	3,182%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	29.770.400,17	29.636.232,12	-0,45%	5,907%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.133.980,68	16.344.463,07	1,30%	3,258%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.083.625,61	9.163.349,47	0,88%	1,827%	100,0%	100,0%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	Fundos Referenciados Renda Fixa	124.670.402,91	124.822.412,50	0,12%	24,88%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	24.790.756,31	25.019.536,98	0,92%	4,987%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	99.879.646,60	99.802.875,52	-0,08%	19,894%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.795.495,68	3.820.379,27	0,66%	0,76%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.795.495,68	3.820.379,27	0,66%	0,76%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 açõ	28.507.692,58	26.239.820,76	-7,96%	5,23%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	28.507.692,58	26.239.820,76	-7,96%	5,23%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
	Fundos de Investimentos em Ações	74.821.074,42	67.179.388,50	-10,21%	13,39%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	13.893.927,53	11.990.054,97	-13,70%	2,390%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.400.226,04	13.221.342,70	-8,19%	2,635%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	32.548.581,23	28.877.573,63	-11,28%	5,756%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.561.684,93	5.197.727,74	-6,54%	1,036%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	5.759.605,28	5.344.003,12	-7,22%	1,065%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.657.049,41	2.548.686,34	-4,08%	0,508%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
	Fundo de Investimento em Participações	19.474.410,53	19.087.467,93	-1,99%	3,80%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FIC PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.784.133,45	5.818.056,39	0,59%	1,160%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTITE	13.690.277,08	13.269.411,54	-3,07%	2,645%	100,0%	100,0%	10,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A

(*)

uf:

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. - Bertprev
Reg.: 019/2017



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 15/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

23 de abril de 2020 16:46

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Boa tarde!

Segue Ata 15/2020 para aprovação e ciência.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 15/2020—aos oito dias do mês de abril 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, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do Bertprev 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 03/04/2020, merecedores de destaque:

	COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
	Taxa Selic Atual	06/02/2020 a 18/03/20	2020	Redução	4,25%	3,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	3,50	3,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-0,48	-1,18
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,50	4,50
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	3,13	3,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,37	2,31
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8728	5,1032
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8255	5,0878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,6444	4,9094
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,1111	4,2683
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	3,2739	3,3441
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –07/04/2020	2020	Redução	2,1338	1,8468
Ibovespa	07/04/2020	2020	Elevação	73.019	76.358
Risco Brasil (JP Morgan)	06/04/2020	2020	Elevação	393	437
Posição dos Investimentos	Dez/19–jan/20	2019	em Mil	575.862	582.196

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 acentuada elevação; o IBOVESPA tem elevação para 76.358 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/04/2020 indica o patrimônio de R\$

501.676M. Os administradores dos fundos de ações têm enviado a posição da carteira aberta inclusive a posição dos fundos mãe conforme solicitado. Foi concluída a ordem de serviço que oficialize a continuidade das reuniões de forma remota, em consonância com o Decreto Municipal nº 3319/2020 e que contemple a interferência nas tarefas administrativas, como por exemplo, os processos de credenciamento das instituições financeiras e respectivos fundos de Investimentos, conforme informou o Presidente do Bertprev. Solicitamos à CAF para efeito de credenciamento o envio dos processos do Banco Santander e respectivos fundos de investimentos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia 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 12:23 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

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

23 de abril de 2020 17:44

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

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

28 de abril de 2020 20:28

Ciente e de acordo.

José Daniel Rorigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado: quinta-feira, 23 de abril de 2020 14:46

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

Assunto: ATA 15/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 15/2020

1 mensagem

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

23 de abril de 2020 17:16

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 qui, 23 23e abr 23e 2020 às 16:46, MARISTELA TEODORO</div><div><maristela.comite@gmail.com> escreveu:</div>

Boa tarde!

Segue Ata 15/2020 para aprovação e ciência.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 15/2020—aos oito dias do mês de abril 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, Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do Bertprev 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 03/04/2020, merecedores de destaque:

	COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
	Taxa Selic Atual	06/02/2020 a 18/03/20	2020	Redução	4,25%	3,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	3,50	3,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-0,48	-1,18
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,50	4,50
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	3,13	3,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,37	2,31
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8728	5,1032
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,8255	5,0878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,6444	4,9094
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	4,1111	4,2683
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –07/04/2020	2020	Elevação	3,2739	3,3441
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –07/04/2020	2020	Redução	2,1338	1,8468
Ibovespa	07/04/2020	2020	Elevação	73.019	76.358
Risco Brasil (JP Morgan)	06/04/2020	2020	Elevação	393	437
Posição dos Investimentos	Dez/19–jan/20	2019	em Mil	575.862	582.196

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

74 ✓

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 acentuada elevação; o IBOVESPA tem elevação para 76.358 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 501.676M. Os administradores dos fundos de ações têm enviado a posição da carteira aberta inclusive a posição dos fundos mãe conforme solicitado. Foi concluída a ordem de serviço que oficialize a continuidade das reuniões de forma remota, em consonância com o Decreto Municipal nº 3319/2020 e que contemple a interferência nas tarefas administrativas, como por exemplo, os processos de credenciamento das instituições financeiras e respectivos fundos de Investimentos, conforme informou o Presidente do Bertprev. Solicitamos à CAF para efeito de credenciamento o envio dos processos do Banco Santander e respectivos fundos de investimentos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia 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 12:23 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Maristela Regina Teodoro Costa

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera
