

Comitê de Investimentos

Ata nº 17/2020—aos vinte e dois dias do mês de abril 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, 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 17/04/2020, 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	3,25	3,00
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-1,96	-2,96
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	4,60	4,80
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,75	2,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,32	1,87
Tx. Juros (ETJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9677	4,3738
Tx. Juros (ETJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9785	4,4582
Tx. Juros (ETJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,7793	4,4248
Tx. Juros (ETJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	3,9247	3,6453
Tx. Juros (ETJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	2,861	2,5637
Tx. Juros (ETJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	1,4929	1,2889
Ibovespa	14/04/2020	2020	Redução	79.918	78.792
Risco Brasil (JP Morgan)	20/04/2020	2020	Elevação	374	403
Posição dos Investimentos	Fev/20–Mar/20	2020	em Mil	575.862	512.503

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA tem redução para 78.792 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.663M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal referente ao mês de março de 2020 elaborado pela LDB Consultoria. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política nacional 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 12:05 horas, e lavrada em ata e assinada pelos presentes a esta reunião.



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

Maristela Regina Teodoro Costa

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



Relatório Semanal de Investimentos

22 de abril de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 09/04/2020	Posição 17/04/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 -R\$ 45.871.694,21	27,37% -7,96%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	519.800.493,76	530.663.926,63	2,09%	100,0%	100,00%	Nível II			
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%					
	Títulos Públicos Federais				30,96%	100,00%				Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.509.596,49	164.290.842,92	3,65%	30,96%	100,00%	100,00%	10,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	106.819.385,23	108.217.507,11	1,31%	20,39%			10,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.311.617,00	19.624.579,00	1,62%	3,698%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	15.930.683,20	16.397.334,80	2,93%	3,090%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	15.979.485,75	16.003.918,96	0,15%	3,016%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	29.910.878,52	30.314.724,62	1,35%	5,713%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.480.502,36	16.623.723,41	0,87%	3,133%					
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.206.218,40	9.253.226,32	0,51%	1,744%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.092.750,65	125.619.641,68	0,42%	23,67%			0,00%	50,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	24.996.843,49	25.018.947,99	0,09%	4,715%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.095.907,16	100.600.693,69	0,50%	18,958%	40,00%	50,00%			
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.838.167,63	3.864.700,29	0,69%	0,73%			0,00%	15,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.838.167,63	3.864.700,29	0,69%	0,728%	5,00%	15,00%			
	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 açõ.	29.659.587,36	30.475.187,76	2,75%	5,74%			0,00%	40,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea A
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	29.659.587,36	30.475.187,76	2,75%	5,743%	30,00%	40,00%			
	Fundos de Investimentos em Ações	76.793.538,47	79.108.578,94	3,01%	14,91%			0,00%	30,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	13.618.669,01	13.923.958,87	2,24%	2,624%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.769.581,02	15.023.123,18	1,72%	2,831%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	33.673.174,66	35.012.878,16	3,98%	6,598%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.824.939,85	5.927.644,55	1,76%	1,117%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.070.993,92	6.325.612,19	4,19%	1,192%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.836.180,01	2.895.361,99	2,09%	0,546%					
	Fundo de Investimento em Participações	19.087.467,93	19.087.467,93	0,00%	3,60%			0,00%	5,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.818.056,39	5.818.056,39	0,00%	1,096%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	13.269.411,54	13.269.411,54	0,00%	2,501%	5,00%	5,00%			

(*)

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. - Financieira
Reg.: 019 - Bertprev



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 17/2020

4 mensagens

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

22 de abril de 2020 14:58

Boa tarde!

Segue Ata 17/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 17/2020—aos vinte e dois dias do mês de abril 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, 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 17/04/2020, mercedores 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	3,25	3,00
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-1,96	-2,96
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	4,60	4,80
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,75	2,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,32	1,87
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9677	4,3738
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9785	4,4582
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,7793	4,4248
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	3,9247	3,6453
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	2,861	2,5637
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	1,4929	1,2889
Ibovespa	14/04/2020	2020	Redução	79.918	78.792
Risco Brasil (JP Morgan)	20/04/2020	2020	Elevação	374	403
Posição dos Investimentos	Fev/20–Mar/20	2020	em Mil	575.862	512.503

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

82 O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA tem redução para 78.792 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.663M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal referente ao mês de março de 2020 elaborado pela LDB Consultoria. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política nacional 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 12:05 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

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

23 de abril de 2020 08:03

Bom dia!

Ciente e de acordo!

Atenciosamente
Jean Mamede

[Texto das mensagens anteriores oculto]

NULL

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

23 de abril de 2020 21:56

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

82

RE: ATA 17/2020

1 mensagem

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

22 de abril de 2020 17:14

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

Ok! De acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>**Enviada:** 2020/04/22 14:59:15**Para:** investimentos@bertprev.sp.gov.br**Assunto:** ATA 17/2020

Boa tarde!

Segue Ata 17/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 17/2020—aos vinte e dois dias do mês de abril 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, 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 C OPOM e relatório *Focus* de 17/04/2020, 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	3,25	3,00
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-1,96	-2,96
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	4,60	4,80
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,75	2,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	2,32	1,87
Tx. Juros (ETJJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9677	4,3738
Tx. Juros (ETJJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,9785	4,4582
Tx. Juros (ETJJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	4,7793	4,4248
Tx. Juros (ETJJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –20/04/2020	2020	Redução	3,9247	3,6453

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -20/04/2020	2020	Redução	2,861	2,5637
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -20/04/2020	2020	Redução	1,4929	1,2889
Ibovespa	14/04/2020	2020	Redução	79.918	78.792
Risco Brasil (JP Morgan)	20/04/2020	2020	Elevação	374	403
Posição dos Investimentos	Fev/20-Mar/20	2020	em Mil	575.862	512.503

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 elevação; o IBOVESPA tem redução para 78.792 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.663M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal referente ao mês de março de 2020 elaborado pela LDB Consultoria. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política nacional e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata e AP Rs 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 12:05 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

29/04/2020

Gmail - ATA 17/2020

83

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

Enviado: quarta-feira, 22 de abril de 2020 12:58

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

Assunto: ATA 17/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

28 de abril de 2020 20:30

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

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: quarta-feira, 22 de abril de 2020 12:58

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

Assunto: ATA 17/2020

Boa tarde!

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.