

Comitê de Investimentos

Ata nº 18/2020—aos vinte e nove 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 24/04/2020, 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	Estável	3,00	3,00
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-2,96	-3,34
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,80	4,80
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,50	2,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,87	1,87
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,3738	4,6575
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4582	4,6788
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4248	4,5783
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	3,6453	4,0045
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	2,5637	3,2166
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	1,2889	1,998
Ibovespa	28/04/2020	2020	Elevação	78.792	81.312
Risco Brasil (JP Morgan)	27/04/2020	2020	Elevação	403	475
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 elevação em todos os vértices; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA tem elevação para 81.312 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 24/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 515.560M. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Acrescente-se a isso a crise política interna devido a posição contrária do Sr. Presidente da República em relação às medidas de isolamento social perpetradas pelos Srs. Prefeitos e Governadores corroboradas pelo Ministério da Saúde alinhadas as determinações da OMS quanto as ações de combate ao Coronavírus, situação agravada pelas recentes exonerações do Ministro da Saúde e do Ministro da Justiça, inclusive causando impacto no resultado semanal de investimentos do Bertprev. Solicitamos ao CAF contato com o Banco Santander para o envio de documentação referente ao fundo



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

Soberano DI para fins de credenciamento e análise da LDB Consultoria sobre o referido fundo. Foi realizado o CALL com a Asset do Banco do Brasil abordando o cenário econômico e apresentando novos produtos. 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 12:10 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

28 de abril de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 17/04/2020	Posição 24/04/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pré-Gestão Res. 4604/17	Limite % Evolução PL Res. 4695/18	Limite Superior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	530.663.926,63	515.560.247,46	-2,85%	100,0%		Nível II					
CP 0184	TÍTULOS PÚBLICOS	164.290.842,92	155.465.476,74	-5,37%	30,15%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	164.290.842,92	155.465.476,74	-5,37%	30,15%							Artigo 7, Inciso I, Alínea A
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	108.217.507,11	105.649.426,20	-2,37%	20,49%							Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	19.624.579,00	19.058.962,00	-2,88%	3,697%							
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16.003.918,96	15.922.459,42	-0,51%	3,014%							
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	30.314.724,62	29.639.828,28	-2,23%	5,749%							
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	16.623.723,41	16.339.830,99	-1,71%	3,169%							
		9.253.226,32	9.148.809,51	-1,13%	1,775%							
02.224.354/0001-45	FUNDOS REFERENCIADOS RENDA FIXA	125.619.641,68	124.317.110,25	-1,04%	24,11%							
21.838.150/0001-49	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.018.947,99	25.029.340,87	0,04%	4,855%							Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.600.693,69	99.287.769,38	-1,31%	19,258%							
14.091.645/0001-91	FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.864.700,29	3.816.102,89	-1,26%	0,74%							Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.864.700,29	3.816.102,89	-1,26%	0,74%							
08.817.414/0001-10	FI ref índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no mín 50 açd	30.475.187,76	29.324.268,19	-3,78%	5,69%							Artigo 8, Inciso I, Alínea A
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	30.475.187,76	29.324.268,19	-3,78%	5,69%							
11.392.165/0001-72	FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES	79.108.578,94	77.900.395,26	-1,53%	15,11%							Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	13.923.958,87	13.878.346,76	-0,33%	2,692%							
11.977.794/0001-64	QUEST AÇÕES FIC FIA	15.023.123,18	14.884.764,98	-0,92%	2,887%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	35.012.878,16	34.630.286,03	-1,09%	6,717%							
09.087.523/0001-91	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.927.644,55	5.659.849,69	-4,52%	1,098%							
15.154.441/0001-15	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.325.612,19	6.165.727,84	-2,53%	1,196%							
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.895.361,99	2.681.419,96	-7,39%	0,520%							
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	19.087.467,93	19.087.467,93	0,00%	3,70%							Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.818.056,39	5.818.056,39	0,00%	1,128%							
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	13.269.411,54	13.269.411,54	0,00%	2,574%							

(*)

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. Financeira
Bertprev
Reg.: 019



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 18/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

29 de abril de 2020 12:24

Boa tarde,

Segue Ata 18/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 18/2020—aos vinte e nove 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 24/04/2020, 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	Estável	3,00	3,00
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-2,96	-3,34
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,80	4,80
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,50	2,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,87	1,87
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,3738	4,6575
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4582	4,6788
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4248	4,5783
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	3,6453	4,0045
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	2,5637	3,2166
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	1,2889	1,998
Ibovespa	28/04/2020	2020	Elevação	78.792	81.312
Risco Brasil (JP Morgan)	27/04/2020	2020	Elevação	403	475
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 elevação em todos os vértices; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA tem elevação para 81.312 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 24/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 515.560M. Continuamos atentos

aos desdobramentos da pandemia e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Acrescente-se a isso a crise política interna devido a posição contrária do Sr. Presidente da República em relação às medidas de isolamento social perpetradas pelos Srs. Prefeitos e Governadores corroboradas pelo Ministério da Saúde alinhadas as determinações da OMS quanto as ações de combate ao Coronavírus, situação agravada pelas recentes exonerações do Ministro da Saúde e do Ministro da Justiça, inclusive causando impacto no resultado semanal de investimentos do Bertprev. Solicitamos ao CAF contato com o Banco Santander para o envio de documentação referente ao fundo Soberano DI para fins de credenciamento e análise da LDB Consultoria sobre o referido fundo. Foi realizado o CALL com a Asset do Banco do Brasil abordando o cenário econômico e apresentando novos produtos. 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 12:10 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

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

29 de abril de 2020 14:41

Ciente e concordo.

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: quarta-feira, 29 de abril de 2020 10:24

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

Assunto: ATA 18/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 18/2020

1 mensagem

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

29 de abril de 2020 16:12

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/04/29 12:25:16
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 18/2020

Boa tarde,

Segue Ata 18/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 18/2020—aos vinte e nove 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 24/04/2020, 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	Estável	3,00	3,00
	PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-2,96	-3,34
	Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	4,80	4,80
	Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,50	2,50
	IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	1,87	1,87
	Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,3738	4,6575
	Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4582	4,6788
	Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	4,4248	4,5783
	Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	3,6453	4,0045
	Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/04/2020	2020	Elevação	2,5637	3,2166

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -28/04/2020	2020	Elevação	1,2889	1,998
Ibovespa	28/04/2020	2020	Elevação	78.792	81.312
Risco Brasil (JP Morgan)	27/04/2020	2020	Elevação	403	475
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 elevação em todos os vértices; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA tem elevação para 81.312 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 24/04/2020 indica o patrimônio de R\$ 515.560M. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e seus reflexos junto ao mercado financeiro. Acrescente-se a isso a crise política interna devido a posição contrária do Sr. Presidente da República em relação às medidas de isolamento social perpetradas pelos Srs. Prefeitos e Governadores corroboradas pelo Ministério da Saúde alinhadas as determinações da OMS quanto as ações de combate ao Coronavírus, situação agravada pelas recentes exonerações do Ministro da Saúde e do Ministro da Justiça, inclusive causando impacto no resultado semanal de investimentos do Bertprev. Solicitamos ao CAF contato com o Banco Santander para o envio de documentação referente ao fundo Soberano DI para fins de credenciamento e análise da LDB Consultoria sobre o referido fundo. Foi realizado o CALL com a Asset do Banco do Brasil abordando o cenário econômico e apresentando novos produtos. 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 12:10 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
