

Comitê de Investimentos

Ata nº 20/2020—aos treze dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte, às dez horas e trinta 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 08/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	2,75	2,50
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-3,76	-4,11
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,00	5,00
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	Elevação	1,64	1,95
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6195	4,6722
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6536	4,7552
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,5829	4,8358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,999	4,3392
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,1188	3,2474
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –12/04/2020	2020	Redução	1,7364	1,5118
Ibovespa	12/05/2020	2020	Redução	79.063	77.871
Risco Brasil (JP Morgan)	11/05/2020	2020	Redução	423	414
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 redução; o IBOVESPA teve redução para 77.871 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 08/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 527.441M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente Abril/2020 da LDB Consultoria. O Comitê opinou pela não renovação do contrato da empresa Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda – Plataforma de Análise de Mercado, considerando principalmente a recente disponibilização da nova plataforma da LDB Consultoria, para acompanhamento dos fundos, fato que gerou sobreposição aos serviços oferecidos pela Paramita, além da redução de custos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política 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



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

cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos. Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:20 horas, e lavrada em ata.

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

13 de maio de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 30/04/2020	Posição 08/05/2020	Varição Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/19	R\$ 576.535.620,84	27,37%
								Evolução PL	-R\$ 49.094.471,90	-8,52%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	529.408.059,06	527.441.148,94	-0,37%	100,0%	Res. 4604/17	Nível II			
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%	Res. 4695/18		Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)
	Títulos Públicos Federais	161.404.755,33	160.108.976,39	-0,80%	30,36%		100,00%	10,00%	30,00%	100,00%
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	161.404.755,33	160.108.976,39	-0,80%	30,36%		100,00%	10,00%	30,00%	100,00%
	Fundos 100% Títulos Públicos	106.906.174,37	107.050.285,99	0,13%	20,30%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.245.733,00	19.295.852,00	0,28%	3,659%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.039.602,00	15.868.969,60	-1,06%	3,009%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	15.906.815,12	15.956.481,99	0,31%	3,025%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.123.676,34	30.161.362,47	0,13%	5,718%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
15.436.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.426.152,54	16.564.229,27	0,84%	3,140%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.164.195,37	9.199.390,66	0,38%	1,744%		100,00%	10,00%	22,00%	100,00%
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.126.241,30	125.223.628,53	0,08%	23,74%		100,00%	10,00%	17,30%	50,00%
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.041.866,17	25.057.700,33	0,06%	4,751%		100,00%	10,00%	17,30%	50,00%
21.838.150/0001-49	ITAUI INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.084.375,13	100.165.928,20	0,08%	18,991%		100,00%	10,00%	17,30%	50,00%
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.828.786,45	3.843.072,08	0,37%	0,73%		100,00%	10,00%	0,70%	15,00%
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.828.786,45	3.843.072,08	0,37%	0,729%		100,00%	10,00%	0,70%	15,00%
	FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no min 50 ações	31.087.973,07	30.635.821,68	-1,45%	5,81%		100,00%	10,00%	7,00%	40,00%
08.817.414/0001-10	ITAUI FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	31.087.973,07	30.635.821,68	-1,45%	5,808%		100,00%	10,00%	7,00%	40,00%
	Fundos de Investimentos em Ações	81.980.919,18	81.506.154,91	-0,58%	15,45%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.619.050,84	14.446.389,40	-1,18%	2,739%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	15.645.137,93	15.739.774,88	0,60%	2,984%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	36.354.100,97	36.258.949,30	-0,26%	6,875%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.979.296,53	5.873.972,66	-1,76%	1,114%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.507.129,26	6.367.292,81	-2,15%	1,207%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.876.203,65	2.819.825,86	-1,96%	0,535%		100,00%	10,00%	20,00%	30,00%
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.073.209,36	0,00%	3,62%		100,00%	10,00%	3,00%	5,00%
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.809.379,41	0,00%	1,101%		100,00%	10,00%	3,00%	5,00%
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	13.263.829,95	13.263.829,95	0,00%	2,515%		100,00%	10,00%	3,00%	5,00%

(*)

Alexandre Hope Herrera

Coord. Admin. Financeira

Reg.: 016/ Bartprev



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 20/2020

4 mensagens

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

13 de maio de 2020 11:25

Bom dia!

Segue Ata 20/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 20/2020—aos treze dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte, às dez horas e trinta 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 08/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	2,75	2,50
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-3,76	-4,11
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,00	5,00
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	Elevação	1,64	1,95
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6195	4,6722
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6536	4,7552
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,5829	4,8358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,999	4,3392
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,1188	3,2474
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –12/04/2020	2020	Redução	1,7364	1,5118
Ibovespa	12/05/2020	2020	Redução	79.063	77.871
Risco Brasil (JP Morgan)	11/05/2020	2020	Redução	423	414
Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408

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 redução; o IBOVESPA teve redução para 77.871 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 08/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 527.441M.

Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente Abril/2020 da LDB Consultoria. O Comitê opinou pela não renovação do contrato da empresa Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda – Plataforma de Análise de Mercado, considerando principalmente a recente disponibilização da nova plataforma da LDB Consultoria, para acompanhamento dos fundos, fato que gerou sobreposição aos serviços oferecidos pela Paramita, além da redução de custos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política 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 11:20 horas, e lavrada em ata.

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>

13 de maio de 2020 13:50

Ok! Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

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

27 de maio de 2020 14:15

[Texto das mensagens anteriores oculto]

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

27 de maio de 2020 14:42

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado: quarta-feira, 27 de maio de 2020 12:15

27/05/2020

Gmail - ATA 20/2020

Para: daniel_bertioga@hotmail.com <daniel_bertioga@hotmail.com>

Assunto: Fwd: ATA 20/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 20/2020

1 mensagem

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

13 de maio de 2020 12:03

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 qua, 13 13e mai 13e 2020 às 11:25, MARISTELA TEODORO</div><div><maristela.comite@gmail.com> escreveu:</div>

Bom dia!

Segue Ata 20/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 20/2020—aos treze dias do mês de maio do ano de dois mil e vinte, às dez horas e trinta 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 08/05/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/04/20 a 06/05/20	2020	Redução	3,75%	3,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Redução	2,75	2,50
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-3,76	-4,11
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,00	5,00
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	Elevação	1,64	1,95
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6195	4,6722
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,6536	4,7552
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	4,5829	4,8358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,999	4,3392
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –12/04/2020	2020	Elevação	3,1188	3,2474
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –12/04/2020	2020	Redução	1,7364	1,5118
Ibovespa	12/05/2020	2020	Redução	79.063	77.871
Risco Brasil (JP Morgan)	11/05/2020	2020	Redução	423	414

Posição dos Investimentos	Mar/20–Abr/20	2020	em Mil	512,503	529,408
---------------------------	---------------	------	--------	---------	---------

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 redução; o IBOVESPA teve redução para 77.871 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 08/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 527.441M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos referente Abril/2020 da LDB Consultoria. O Comitê opinou pela não renovação do contrato da empresa Paramita Tecnologia Consultoria Financeira Ltda – Plataforma de Análise de Mercado, considerando principalmente a recente disponibilização da nova plataforma da LDB Consultoria, para acompanhamento dos fundos, fato que gerou sobreposição aos serviços oferecidos pela Paramita, além da redução de custos. Continuamos atentos aos desdobramentos da pandemia e da crise política 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 11:20 horas, e lavrada em ata.

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
