



Comitê de Investimentos

Ata nº 22/2020—aos vinte e sete 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, Alexandre Hope Herrera e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, registra-se a ausência da Sra. Maristela Regina Teodoro Costa. 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 22/05/2020, 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	Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada	2020	Redução	-5,12	-5,89
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	5,28	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,61	1,42
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –26/04/2020	2020	Elevação	4,6686	4,8156
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –26/04/2020	2020	Elevação	4,6992	4,7507
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –26/04/2020	2020	Redução	4,663	4,5019
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –26/04/2020	2020	Redução	4,1089	3,7588
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –26/04/2020	2020	Redução	2,9932	2,4877
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –26/04/2020	2020	Redução	1,222	1,0920
Ibovespa	26/05/2020	2020	Elevação	80.742	85.468
Risco Brasil (JP Morgan)	25/05/2020	2020	Redução	427	405
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 redução em todos os vértices exceto nos vencimentos em 2054 e 2050; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 85.468 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.695M. Participaram remotamente da reunião os Srs. Rafael, Marcelo e Thiago representantes da Vinci Partners. 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 12:35 horas, e lavrada em ata.



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

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



Relatório Semanal de Investimentos

27 de maio de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 15/05/2020	Posição 22/05/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Des/19 Evolução PL	RS 576.535.620,84 -RS 45.840.522,01	Enquadramento
TOTAL PATRIMÔNIO										
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	518.886.984,95	530.695.098,83	2,28%	100,0%	100,0%				Enquadramento
Títulos Públicos Federais										
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	155.094.580,64	158.735.111,22	2,35%	29,91%	100,0%	100,0%			Artigo 7, Inciso I, Alínea A
Fundos 100% Títulos Públicos										
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.287.216,00	107.937.697,97	1,55%	20,34%					Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	15.588.480,00	19.593.197,00	1,59%	3,692%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	16.007.931,78	16.060.526,37	0,33%	3,026%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.051.347,55	30.248.206,34	0,66%	5,700%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.130.040,75	16.669.606,73	3,35%	3,141%					
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.220.461,38	9.278.535,53	0,63%	1,748%					
Fundos Referenciados Renda Fixa										
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	125.106.792,02	125.407.529,63	0,24%	23,63%					Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF DE FI	25.060.791,16	25.078.641,92	0,07%	4,726%					
FI Renda Fixa Crédito Privado										
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.850.004,73	3.881.698,80	0,82%	0,73%					Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
FI ref Índice de RV divulgado pela B3 - Comp por no min 50 ações										
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	29.647.046,98	31.562.554,15	6,46%	5,95%					Artigo 8, Inciso I, Alínea A
Fundos de Investimentos em Ações										
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.221.423,77	14.686.062,95	3,27%	2,767%					Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	BTG AÇÕES FIC FIA	15.432.272,28	16.042.219,97	3,95%	3,023%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	35.551.657,55	37.681.835,99	5,99%	7,100%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	5.758.814,66	6.152.443,32	6,84%	1,159%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.129.287,95	6.643.891,97	8,40%	1,252%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.736.417,55	2.890.843,50	5,64%	0,545%					
Fundo de Investimento em Participações										
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	19.073.209,36	19.073.209,36	0,00%	3,59%					Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIE	5.809.379,41	5.809.379,41	0,00%	1,095%					
		13.263.829,95	13.263.829,95	0,00%	2,499%					
					0,000%					

(*)

Alexandre Hope Henri
Coord. Adm. Berktrev
Reg.: 043

Jean Mamede

De: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Enviado em: quarta-feira, 27 de maio de 2020 13:41
Para: jean@bertprev.sp.gov.br
Assunto: Assunto: ata 22

De acordo
Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

<div>Em qua, 27 27e mai 27e 2020 às 13:26,
jean@bertprev.sp.gov.br</div><div><jean@bertprev.sp.gov.br> escreveu:</div>

Boa tarde!

Segue ata.

Comitê de Investimentos

Ata nº 22/2020—aos vinte e sete 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, Alexandre Hope Herrera e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade**, registra-se a ausência da Sra. **Maristela Regina Teodoro Costa**. 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 22/05/2020, mercedores 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		Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada 2020		Redução	-5,12	-5,89
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada 2020		Elevação	5,28	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,61	1,42

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6686	4,8156
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6992	4,7507
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,663	4,5019
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,1089	3,7588
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	2,9932	2,4877
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	1,222	1,0920
Ibovespa	26/05/2020	2020	Elevação	80.742	85.468
Risco Brasil (JP Morgan)	25/05/2020	2020	Redução	427	405
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 redução em todos os vértices exceto nos vencimentos em 2054 e 2050; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 85.468 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.695M. Participaram remotamente da reunião os Srs. Rafael, Marcelo e Thiago representantes da Vinci Partners. 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 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

Jean Mamede

De: José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Enviado em: quarta-feira, 27 de maio de 2020 13:43
Para: jean@bertprev.sp.gov.br
Assunto: RE: ata 22

ciente e de acordo.
José Daniel Rodrigues

De: jean@bertprev.sp.gov.br <jean@bertprev.sp.gov.br>
Enviado: quarta-feira, 27 de maio de 2020 11:26
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>
Assunto: ata 22

Boa tarde!
Segue ata.

Comitê de Investimentos

Ata nº 22/2020 – aos vinte e sete 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, Alexandre Hope Herrera e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade**, registra-se a ausência da Sra. **Maristela Regina Teodoro Costa**. 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 22/05/2020, mercedores 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		Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada 2020		Redução	-5,12	-5,89
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada 2020		Elevação	5,28	5,40
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,61	1,42
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6686	4,8156
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6992	4,7507
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,663	4,5019
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,1089	3,7588

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. Anbima – - 2025)	26/04/2020	2020	Redução	2,9932	2,4877
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - Anbima – 2022)	26/04/2020	2020	Redução	1,222	1,0920
Ibovespa	26/05/2020	2020	Elevação	80.742	85.468
Risco Brasil (JP Morgan)	25/05/2020	2020	Redução	427	405
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 redução em todos os vértices exceto nos vencimentos em 2054 e 2050; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 85.468 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.695M. Participaram remotamente da reunião os Srs. Rafael, Marcelo e Thiego representantes da Vinci Partners. 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 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel

Rodrigues

Jean Mamede de

Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope

Herrera

Jean Mamede

De: [wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>](mailto:wilson.carrasco@uol.com.br)
Enviado em: quarta-feira, 27 de maio de 2020 14:05
Para: jean@bertprev.sp.gov.br
Assunto: RE: ata 22

Ciente e de acordo.

De: jean@bertprev.sp.gov.br
Enviada: 2020/05/27 13:26:48
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ata 22

Boa tarde!

Segue ata.

Comitê de Investimentos

Ata nº 22/2020—aos vinte e sete 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, Alexandre Hope Herrera e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade**, registra-se a ausência da Sra. **Maristela Regina Teodoro Costa**. 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 22/05/2020, mercedores 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		Estável	2,25	2,25
PIB	Mediana agregada 2020		Redução	-5,12	-5,89
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada 2020		Elevação	5,28	5,40

Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,25	2,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Redução	1,61	1,42
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6686	4,8156
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima – 26/04/2020	2020	Elevação	4,6992	4,7507
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,663	4,5019
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	4,1089	3,7588
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	2,9932	2,4877
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima – 26/04/2020	2020	Redução	1,222	1,0920
Ibovespa	26/05/2020	2020	Elevação	80.742	85.468
Risco Brasil (JP Morgan)	25/05/2020	2020	Redução	427	405
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 redução em todos os vértices exceto nos vencimentos em 2054 e 2050; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 85.468 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 22/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 530.695M. Participaram remotamente da reunião os Srs. Rafael, Marcelo e Thiego representantes da Vinci Partners. 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 12:35 horas, e lavrada em ata.< /p>

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera
