

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, 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	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	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	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. 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 13:00 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

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 23/2020

2 mensagens

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

3 de junho de 2020 13:09

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, 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	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	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	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório

semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. 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 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

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

3 de junho de 2020 13:32

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 23/2020

1 mensagem

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

3 de junho de 2020 14:15

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, 3 3e jun 3e 2020 às 13:10, MARISTELA TEODORO</div><div><maristela.comite@gmail.com> escreveu:</div>

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, 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	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	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	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375

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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. 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 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

José Daniel Rodrigues _____

Jean Mamede de Oliveira _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 23/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

3 de junho de 2020 13:09

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 23/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 23/2020—aos três dias do mês de junho 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 e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** 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 29/05/2020, 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	-5,89	-6,25
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,40	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	1,42	1,39
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8694 d.u. - 2054)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,8156	4,7774
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,7507	4,7096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	4,5019	4,4497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	3,7588	3,6734
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	2,4877	2,3345
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –02/06/2020	2020	Redução	1,0920	0,8014
Ibovespa	02/06/2020	2020	Elevação	85.468	91.046
Risco Brasil (JP Morgan)	02/06/2020	2020	Redução	405	375
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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 91.046 pontos; o relatório

semanal dos investimentos em 29/05/2020 indica o patrimônio de R\$ 540.839M. Estão sendo enviados ao Sr. Presidente do Bertprev os processos de credenciamento nº. 175/2018, 176/2018 e 113/2020 relativos ao Banco Santander. Participaram remotamente da reunião os Srs. Walter, Luiz e França representantes da AZ Quest. 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 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

José Daniel Rodrigues

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

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

3 de junho de 2020 13:32

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

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

18 de junho de 2020 14:36

Boa Tarde!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado: quarta-feira, 3 de junho de 2020 11:09
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>
Assunto: ATA 23/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



Relatório Semanal de Investimentos

03 de junho de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 22/05/2020	Posição 29/05/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/19 Evolução PL	RS 576.535.620,84 -RS 35.696.152,98	27,37% -6,19%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	530.695.098,83	540.839.467,86	1,91%	100,0%					
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	158.735.111,22	160.430.629,99	1,07%	29,66%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.735.111,22	160.430.629,99	1,07%	29,66%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	107.937.697,97	108.896.346,96	0,89%	20,13%			10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.593.197,00	19.852.651,00	1,32%	3,671%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2020 II TP	16.087.626,00	16.322.410,00	1,46%	3,018%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TP VII FI	16.060.526,37	16.105.334,29	0,28%	2,978%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.248.206,34	30.446.645,54	0,66%	5,630%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.669.606,73	16.837.038,97	1,00%	3,113%					
19.303.795/0001-35	BB PREV TP IPCA III	9.278.535,53	9.332.267,16	0,58%	1,726%					
					0,000%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	125.407.529,63	125.721.531,11	0,25%	23,25%			0,00%	17,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
02.224.354/0001-45	SANTANDER FI INSTITUCIONAL RF REF DI	25.078.641,92	25.096.228,29	0,07%	4,640%	40,00%	50,00%			
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	100.328.887,71	100.625.302,82	0,30%	18,605%					
					0,000%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.881.698,80	3.911.985,22	0,78%	0,72%			0,00%	0,70%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.881.698,80	3.911.985,22	0,78%	0,723%	5,00%	15,00%			
					0,000%					
	Fundos de Investimentos em Ações	115.659.851,85	122.805.765,22	6,18%	22,71%			0,00%	20,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	14.686.062,95	15.465.340,46	5,31%	2,860%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	16.042.219,97	17.104.917,82	6,62%	3,163%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	37.681.835,99	40.090.166,73	6,39%	7,413%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.152.443,32	6.450.559,51	4,85%	1,193%	20,00%	30,00%			
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	6.643.891,97	7.047.376,58	6,07%	1,303%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	31.562.554,15	33.555.363,43	6,31%	6,204%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	2.890.843,50	3.092.040,69	6,96%	0,572%					
					0,000%					
	Fundo de Investimento em Participações	19.073.209,36	19.073.209,36	0,00%	3,53%			0,00%	3,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.809.379,41	5.809.379,41	0,00%	1,074%	5,00%	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%	2,452%					

(*)

Alexandre Hope Herrera

Coord. Adm. Financeira

Reg.: 019 Bertprev