

Comitê de Investimentos

Ata nº 41/2020—aos sete dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. Registra-se a ausência por razões de saúde do Sr. José Daniel Rodrigues. 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 02/10/2020, mercedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-5,04	-5,02
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,00	2,14
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	4,7983	4,7719
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	4,7409	4,7163
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	4,497	4,4798
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	3,7758	3,7742
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	2,5643	2,5369
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -06/10/2020	2020	Elevação	0,3374	0,4712
Ibovespa	06/10/2020	2020	Elevação	93.580	95.615
Risco Brasil (JP Morgan)	05/10/2020	2020	Redução	347	331
Posição dos Investimentos	Jul/20-Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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, com exceção do 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 95.615 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 577.772M. Participou da reunião a Sra. Priscila Navarro representando a Icatu Investimentos. A Secretaria de Previdência respondeu a consulta do Bertprev confirmando o prazo da entrega da Política de Investimentos em 31/12/2020. Recebemos da Sra. Coordenadora Jurídico Previdenciário a sentença de aprovação de contas de 2019. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das

assinaturas nessa Ata 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 12:30 horas, e lavrada em ata.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
079/2020	30/09/2020	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
080/2020	07/10/2020	110.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
081/2020	07/10/2020	70.463,48	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
082/2020	06/10/2020	70.463,48	Resgate	KINEA PRIVATE EQUITY II FEEDER INST I FIP

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Assunto: ATA 41/2020

1 mensagem

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

Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>

Para: maristela.comite@gmail.com

8 de outubro de 2020 11:24

De acordo.

Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qui, 8 de out 8 de 2020 às 11:21, MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Bom dia!

Segue Ata 41/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 41/2020—aos sete dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Registra-se a ausência por razões de saúde do Sr. José Daniel Rodrigues. 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 02/10/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-5,04	-5,02
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,00	2,14
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,7983	4,7719
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,7409	4,7163
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,497	4,4798
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	3,7758	3,7742
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	2,5643	2,5369
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –06/10/2020	2020	Elevação	0,3374	0,4712
Ibovespa	06/10/2020	2020	Elevação	93.580	95.615

Risco Brasil (JP Morgan)	05/10/2020	2020	Redução	347	331
Posição dos Investimentos	Jul/20–Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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, com exceção do 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 95.615 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 577.772M. Participou da reunião a Sra. Priscila Navarro representando a Icatu Investimentos. A Secretaria de Previdência respondeu a consulta do Bertprev confirmando o prazo da entrega da Política de Investimentos em 31/12/2020. Recebemos da Sra. Coordenadora Jurídico Previdenciário a sentença de aprovação de contas de 2019. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata 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 12:30 horas, e lavrada em ata.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
079/2020	30/09/2020	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
080/2020	07/10/2020	110.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
081/2020	07/10/2020	70.463,48	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
082/2020	06/10/2020	70.463,48	Resgate	KINEA PRIVATE EQUITY II FEEDER INST I FIP

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos

Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina

Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 41/2020

1 mensagem

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

8 de outubro de 2020 11:28

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>**Enviada:** 2020/10/08 11:21:19**Para:** wilson.paschoal@uol.com.br, daniel_bertioga@hotmail.com, clayfs@yahoo.com.br, jean@bertprev.sp.gov.br, investimentos@bertprev.sp.gov.br**Assunto:** ATA 41/2020

Bom dia!

Segue Ata 41/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 41/2020—aos sete dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. Registra-se a ausência por razões de saúde do Sr. José Daniel Rodrigues.** 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 02/10/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-5,04	-5,02
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	2,00	2,14
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,7983	4,7719
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,7409	4,7163
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –06/10/2020	2020	Redução	4,497	4,4798

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	3,7758	3,7742
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -06/10/2020	2020	Redução	2,5643	2,5369
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -06/10/2020	2020	Elevação	0,3374	0,4712
Ibovespa	06/10/2020	2020	Elevação	93.580	95.615
Risco Brasil (JP Morgan)	05/10/2020	2020	Redução	347	331
Posição dos Investimentos	Jul/20-Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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, com exceção do 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 95.615 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 577.772M. Participou da reunião a Sra. Priscila Navarro representando a Icatu Investimentos. A Secretaria de Previdência respondeu a consulta do Bertprev confirmando o prazo da entrega da Política de Investimentos em 31/12/2020. Recebemos da Sra. Coordenadora Jurídico Previdenciário a sentença de aprovaçã o de contas de 2019. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata 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 12:30 horas, e lavrada em ata.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
079/2020	30/09/2020	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
080/2020	07/10/2020	110.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
081/2020	07/10/2020	70.463,48	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
082/2020	06/10/2020	70.463,48	Resgate	KINEA PRIVATE EQUITY II FEEDER INST I FIP

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos

Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina

Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



*

Relatório Semanal de Investimentos

07 de outubro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 25/09/2020	Posição 02/10/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3022/10	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 R\$ 1.187.204,70	27,37% 0,21%
XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	588.282.200,84	577.722.825,54	-1,79%	100,0%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federais	167.116.016,26	164.226.920,85	-1,73%	28,43%					
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	167.116.016,26	164.226.920,85	-1,73%	28,43%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	96.010.627,31	95.184.876,05	-0,86%	16,48%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.912.415,88	16.776.201,82	-0,81%	2,904%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.690.866,50	5.668.856,23	-0,39%	0,981%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.892.359,49	30.629.255,77	-0,85%	5,302%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.578.252,80	16.383.856,80	-1,17%	2,836%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.902.246,00	19.724.913,00	-0,89%	3,414%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.034.486,64	6.001.792,43	-0,54%	1,039%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	163.568.504,36	161.032.476,38	-1,55%	27,87%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	22.302.248,92	20.566.016,09	-7,79%	3,560%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	101.408.402,87	101.068.792,04	-0,33%	17,494%					
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.857.852,57	39.397.668,25	-1,15%	6,819%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.013.532,89	3.995.671,41	-0,45%	0,69%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.013.532,89	3.995.671,41	-0,45%	0,692%					
	Fundos de Investimentos em Ações	140.341.983,52	136.305.700,16	-2,88%	23,59%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	19.307.899,40	18.674.121,59	-3,28%	3,232%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.842.232,80	17.371.444,99	-2,64%	3,007%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.937.931,58	6.700.460,55	-3,42%	1,160%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	47.322.663,12	46.068.397,16	-2,65%	7,974%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.642.279,63	36.480.728,96	-3,09%	6,315%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.997.615,88	7.806.468,13	-2,39%	1,351%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.291.361,11	3.204.078,78	-2,65%	0,555%					
	Fundo de Investimento em Participações	17.231.536,50	16.977.180,69	-1,48%	2,94%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.789.239,87	5.766.859,19	-0,39%	0,998%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	11.442.296,63	11.210.321,50	-2,03%	1,940%					

(*)

José Ferreira Melo Filho
Bortprev - Reg. 007
Setor Financeiro

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 014 Bortprev